

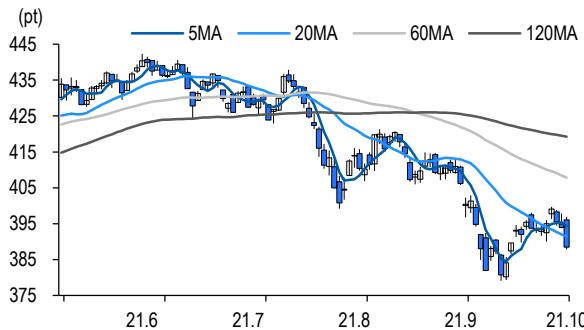


선물옵션시장 지표

2021.11.1

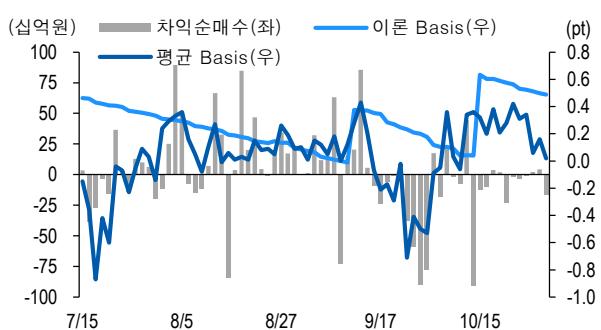
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	388.47	-1.38	-5.42	8,085.2	-
선물 12월물	388.15	-1.57	-6.20	28,920.3	273,967
선물 3월물	384.50	-1.52	-5.95	16.8	11,790
11월물(mini)	388.04	-1.56	-6.14	2,050.4	62,206
12월물(mini)	388.40	-1.51	-6.10	11.1	5,358



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.49	0.02	-0.32	-0.12%
베이시스(mini)	0.15	-0.13	-0.43	-0.07%
제1스프레드(SP)	-2.90	-3.84	-3.80	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.15	-0.39	-0.39	-0.14%



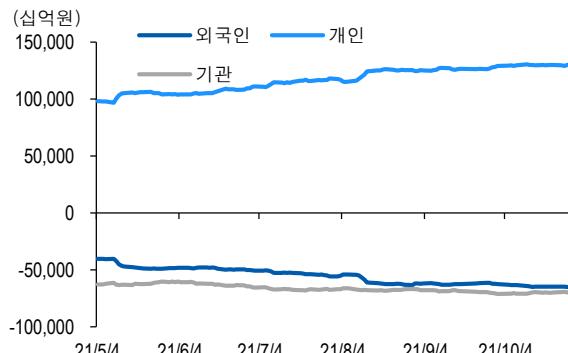
투자주체별 매매 동향

(십억원)

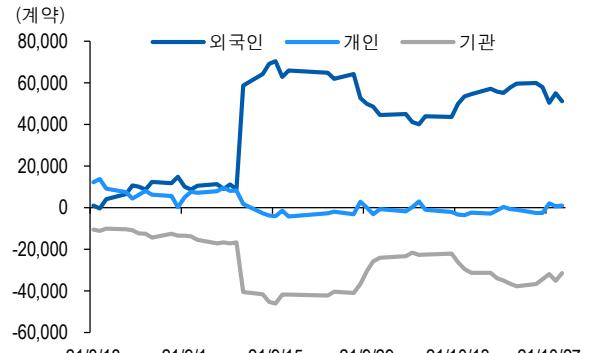
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-800.6	26.4	-774.2	-7.9	-712.4	-318.2	-69.2	-1.7	1.3	8.6
개인	1,257.0	54.7	1,311.8	0.0	20.9	-49.1	75.8	-1.1	5.4	-30.4
기관	-475.9	-76.2	-552.1	-8.9	-17.4	370.9	-12.4	3.5	-7.0	22.9
금융투자	-347.8	-145.1	-492.9	0.0	-5.7	701.5	-12.2	3.0	-7.5	47.0
투신	-14.6	9.7	-4.9	-0.7	0.0	-333.1	0.0	-0.3	0.2	-49.6
은행+보험+기타금융	1.6	62.1	63.6	0.0	-7.7	-15.9	-0.2	0.7	0.3	-0.8
연기금+국가지자체	-78.6	-0.6	-79.2	-8.2	-0.1	18.4	0.0	0.0	0.0	26.4
기타법인	19.5	-5.0	14.5	0.0	0.9	-3.5	5.7	-0.7	0.3	-1.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

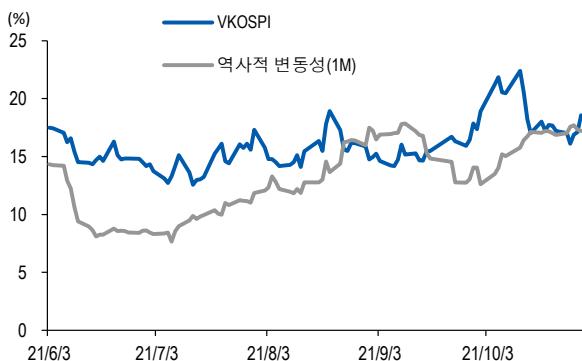
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	924,487	233.5	776,084	15.0%	지수옵션 전체	1,941,253	603.7
Put	1,016,766	370.3	1,248,189	18.0%	PCR(금액기준)	1.59	VKOSPI 18.55%(+1.46%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	0.65	-0.94	96,636	19,720	4,613	14.9
	400.0(K+2)	1.04	-1.30	101,151	25,880	6,252	15.2
	397.5(K+1)	1.50	-1.80	62,373	11,298	1,430	15.1
	395.0(K+0)	2.20	-2.25	46,126	13,430	3,972	15.4
	392.5(K-1)	3.11	-2.78	16,893	6,890	2,310	15.7
Put	397.5(K+1)	10.95	4.36	5,023	3,397	41	17.6
	395.0(K+0)	9.12	3.84	10,428	8,362	-453	17.5
	392.5(K-1)	7.51	3.28	12,512	8,207	627	17.6
	390.0(K-2)	6.11	2.78	33,927	28,276	652	17.8
	387.5(K-3)	4.95	2.31	43,936	10,569	-100	18.1

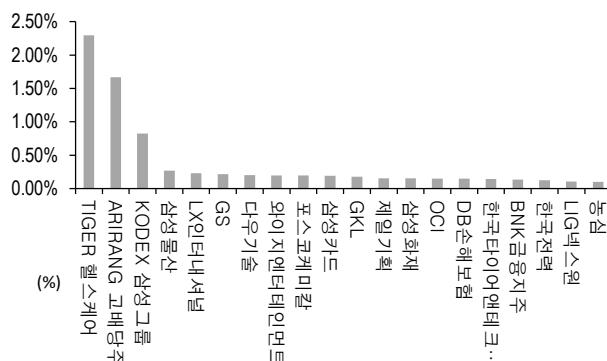
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,494,153	2,750.0	5,506,854	-10,849	-27,421	-47,645	76,185	8.6	-30.4	22.9	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
GS 건설	41,200	-0.12	12.8	73.3	40,644	81	-0.06%	-1,622	-633	2,255	1,561
현대차	208,000	-0.95	83.0	64.4	48,309	-306	0.03%	3,116	-346	-2,765	-1,714
SK 하이닉스	103,500	-2.36	259.2	63.0	110,507	-779	-0.20%	-6,037	18,702	-12,810	909
삼성전자	69,700	-1.41	686.9	59.1	1,197,216	-35,742	0.01%	-11,519	-33,049	47,740	15,354
NAVER	406,500	-1.81	105.6	55.3	62,809	584	0.01%	2,750	-94	-2,618	-1,883
SK 머티리얼즈	378,200	-1.43	4.2	50.0	1,995	56	-0.38%	143	7	-150	0
기아	84,700	-1.85	81.2	49.7	61,337	-2,214	0.01%	-2,870	392	2,378	-2,213
아모레퍼시픽	181,500	-2.16	18.4	48.7	16,609	-993	0.09%	-296	-865	1,161	-630
한화	33,500	-3.46	5.9	48.5	15,119	-3,253	-0.07%	4,789	-5,336	547	563
LG 이노텍	209,000	-0.24	33.9	47.2	7,167	-1,146	-0.09%	-125	-1,054	1,179	831

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터