

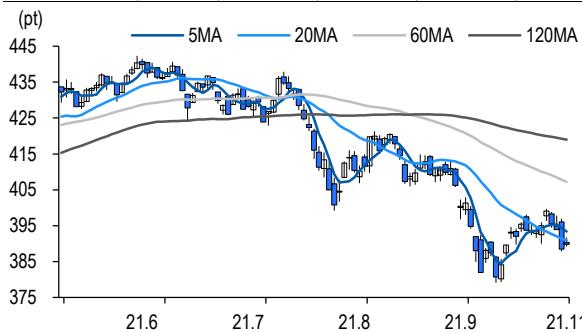


선물옵션시장 지표

2021.11.2

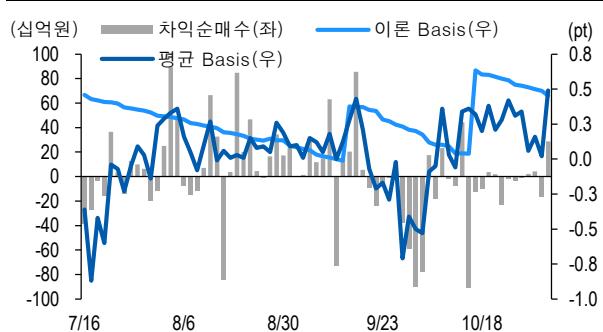
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.81	0.34	1.34	6,539.9	-
선물 12월물	390.90	0.71	2.75	19,511.6	272,340
선물 3월물	386.75	0.59	2.25	13.1	11,821
11월물(mini)	390.52	0.64	2.48	1,917.1	74,730
12월물(mini)	390.64	0.64	2.24	10.3	9,012



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.45	0.49	1.09	0.01%
베이시스(mini)	0.12	0.21	0.71	0.02%
제1스프레드(SP)	-2.89	-3.83	-3.80	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	0.75	0.75	0.16%



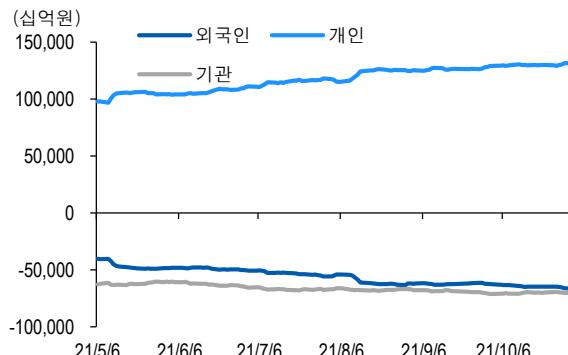
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.5	2.2	-356.4	0.0	-379.8	991.0	-320.6	-2.2	3.4	35.2
개인	-265.9	18.4	-247.5	0.0	16.6	-300.2	10.9	-2.0	0.5	-84.4
기관	636.8	-25.6	611.2	28.7	-15.3	-624.6	309.6	4.2	-3.9	49.1
금융투자	764.3	-5.8	758.5	5.6	3.4	-920.3	310.0	4.0	-2.9	51.0
투신	-33.2	2.1	-31.1	0.0	3.5	354.5	-0.5	0.0	0.1	5.6
은행+보험+기타금융	-8.4	-8.6	-17.0	0.0	-0.5	-50.2	0.1	0.2	-1.1	-0.2
연기금+국가지자체	-65.2	0.7	-64.6	17.3	-27.3	-8.6	0.1	0.0	0.0	-7.2
기타법인	-12.4	5.0	-7.4	0.0	0.9	-66.2	0.1	0.0	0.0	0.0

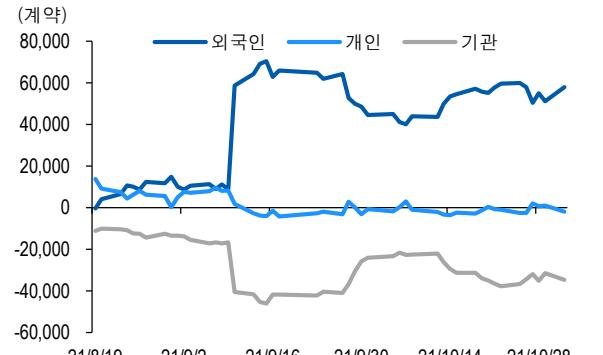
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



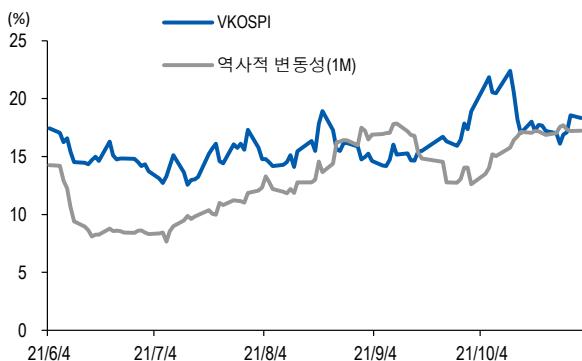
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	606,711	171.9	795,200	16.7%	지수옵션 전체	1,275,941	346.1	2,067,146							
Put	669,230	174.2	1,271,946	18.3%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	18.33%(-0.22%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	395.0(K+3)	2.46	0.26	56,075	14,243	813	16.7	Put	390.0(K+1)	4.35	-1.76	13,796	28,554	278	16.0
	392.5(K+2)	3.52	0.41	27,335	7,902	1,012	17.3		387.5(K+0)	3.42	-1.53	18,369	10,989	420	16.9
	390.0(K+1)	4.87	0.67	12,601	9,198	2,018	18.1		385.0(K-1)	2.65	-1.27	36,002	19,103	1,231	17.6
	387.5(K+0)	6.48	0.98	2,833	3,447	502	19.2		382.5(K-2)	2.04	-1.12	41,648	14,364	204	18.3
	385.0(K-1)	8.18	0.87	1,260	3,194	223	20.0		380.0(K-3)	1.56	-0.94	61,730	26,424	71	18.9

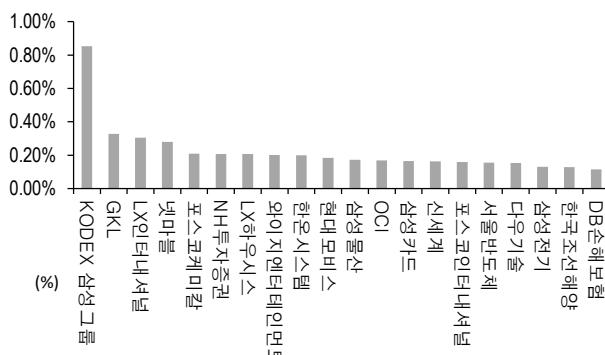
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	2,851,410	2,195.2	5,492,323	-14,531	44,408	-76,128	31,393	35.2	-84.4	49.1
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
기아	84,100	-0.71	54.6	70.5	54,837	-6,500	-0.08%	373	-9,222	8,849
삼성 SDI	721,000	-1.77	111.3	60.3	26,229	-1,335	-0.03%	679	-1,773	1,098
NAVER	407,500	0.25	80.5	58.6	58,645	-4,164	-0.02%	-624	-1,672	2,314
영진약품	4,760	2.59	0.7	57.3	8,701	1,744	-0.02%	623	9	-630
현대차	207,000	-0.48	46.7	57.0	46,966	-1,343	0.01%	413	-2,889	2,476
삼성전자	70,100	0.57	452.6	56.4	1,177,321	-19,895	0.01%	-3,613	-10,951	14,564
현대모비스	253,000	0.20	29.4	56.0	12,617	-38	0.18%	617	-257	-360
넷마블	127,500	3.24	12.8	55.8	8,993	-1,397	0.28%	2,044	191	-2,235
GS 건설	42,050	2.06	8.0	55.0	39,760	-884	0.01%	-1,421	88	1,333
LG 화학	832,000	-0.72	96.1	52.4	10,598	-47	0.00%	0	-39	39

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터