

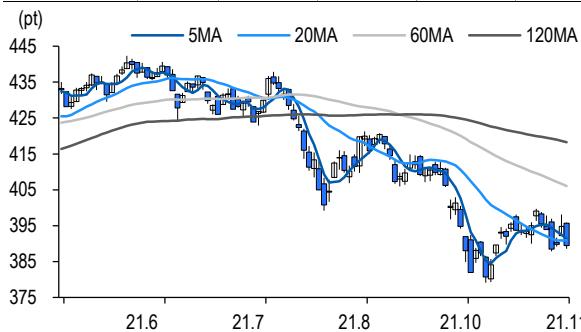


선물옵션시장 지표

2021.11.4

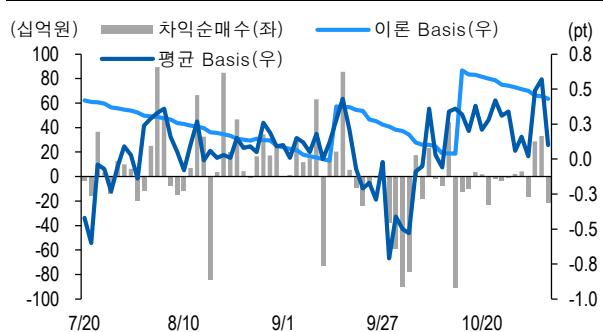
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.48	-1.35	-5.34	6,901.8	-
선물 12월물	389.05	-1.66	-6.55	24,545.8	275,445
선물 3월물	385.30	-1.58	-6.20	28.2	12,034
11월물(mini)	388.90	-1.61	-6.38	1,685.1	88,778
12월물(mini)	389.26	-1.60	-6.26	22.2	16,972



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.43	0.10	-0.43	-0.08%
베이시스(mini)	0.10	-0.11	-0.58	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.89	-3.90	-3.95	-0.26%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	-0.54	-0.54	-0.16%



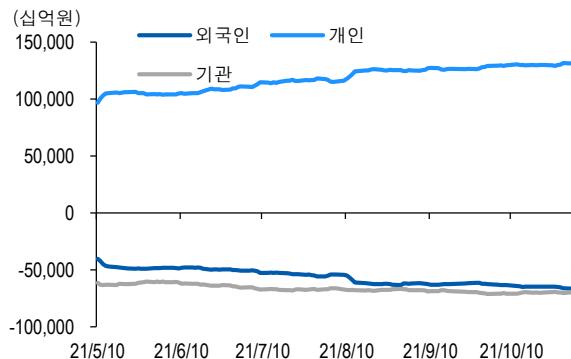
투자주체별 매매 동향

(십억원)

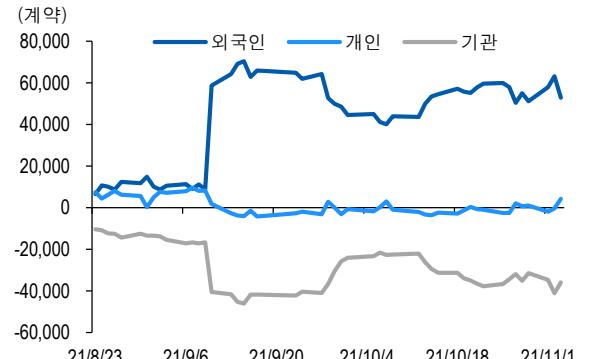
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-449.4	736.4	287.0	0.0	-259.6	-960.8	-39.0	2.0	1.0	-4.0
개인	842.0	-1,811.2	-969.2	0.0	1.3	388.4	57.0	-1.0	4.0	7.0
기관	-418.1	1,107.2	689.0	-21.3	-22.9	540.4	-29.0	-1.0	-5.0	-2.0
금융투자	-552.3	1,308.4	756.1	-1.7	-4.1	967.9	-28.0	0.0	-5.0	22.0
투신	-8.1	6.8	-1.3	0.0	-15.0	-408.8	0.0	0.0	0.0	-26.0
은행+보험+기타금융	-4.7	-40.6	-45.3	0.0	-12.7	1.2	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	146.5	-176.1	-29.6	-19.5	10.9	-20.0	0.0	0.0	0.0	2.0
기타법인	25.6	-32.4	-6.9	0.0	-0.2	32.0	10.0	0.0	0.0	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	846,543	195.4	846,341	15.6%	지수옵션 전체	2,065,226	568.5	2,170,833
Put	1,218,683	373.0	1,324,492	18.9%	PCR(금액기준)	1.91	VKOSPI	18.36%(+1.08%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	402.5(K+3)	0.42	-0.79	99,397	23,616	4,852	15.7	397.5(K+1)
	400.0(K+2)	0.68	-1.24	116,913	30,955	4,574	15.5	395.0(K+0)
	397.5(K+1)	1.11	-1.79	81,874	17,060	2,617	15.6	392.5(K-1)
	395.0(K+0)	1.73	-2.43	75,414	17,652	1,819	15.7	390.0(K-2)
	392.5(K-1)	2.59	-3.09	31,031	10,215	3,285	15.8	387.5(K-3)
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	397.5(K+1)	9.74	4.64	3,878	4,065	17	19.4	
	395.0(K+0)	7.79	3.93	15,631	10,148	-582	18.7	
	392.5(K-1)	6.14	3.23	23,752	9,760	888	18.5	
	390.0(K-2)	4.78	2.61	64,084	27,677	-1,701	18.7	
	387.5(K-3)	3.58	2.00	78,325	14,599	-1,561	18.7	

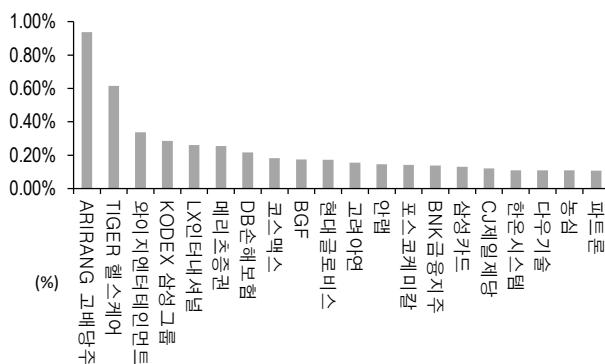
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,179,383	2,402.4	5,654,160	-41,014	-88,904	19,265	71,390	-3.7	7.1	-2.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
GS 건설	42,650	-0.58	14.3	105.3	40,467	-4,427	0.08%	740	-4,411	3,671
영진약품	4,810	-2.24	1.7	86.7	9,347	-34	-0.25%	-1,523	180	1,343
현대차	208,500	-0.71	69.8	70.4	47,417	-1,322	0.03%	902	-1,356	459
삼성전자	70,400	-1.68	622.6	70.2	1,166,487	-24,513	0.00%	-5,325	-8,607	14,751
카카오	125,000	-2.34	224.8	61.7	123,496	2,194	-0.19%	-1,088	3,481	-2,170
SK 하이닉스	106,500	-1.39	184.7	57.0	105,760	-5,496	0.00%	4,985	2,259	-7,384
SK 이노베이션	244,500	-1.81	26.5	56.5	15,861	-1,070	0.07%	-344	37	307
현대제철	43,700	-0.91	10.4	53.8	17,317	1,123	-0.02%	-1,565	-193	1,708
현대모비스	253,000	-0.78	22.9	53.3	13,337	739	0.10%	258	524	-782
삼성 SDI	731,000	-0.14	96.2	51.9	22,497	-183	-0.03%	31	-132	120

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터