

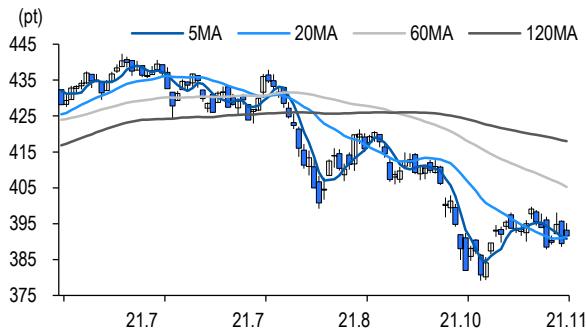


선물옵션시장 지표

2021.11.5

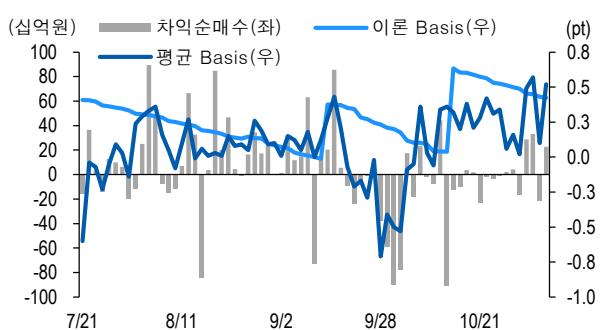
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	391.54	0.53	2.06	10,176.5	-
선물 12월물	392.45	0.87	3.40	25,990.7	271,096
선물 3월물	388.45	0.82	3.15	41.0	12,070
11월물(mini)	392.18	0.84	3.28	2,409.1	96,274
12월물(mini)	392.60	0.91	3.34	15.8	18,390



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.42	0.52	0.91	0.02%
베이시스(mini)	0.08	0.20	0.64	0.03%
제1스프레드(SP)	-2.88	-3.95	-3.95	-0.27%
합성선물 베이시스(ATM)	0.08	0.60	0.60	0.13%



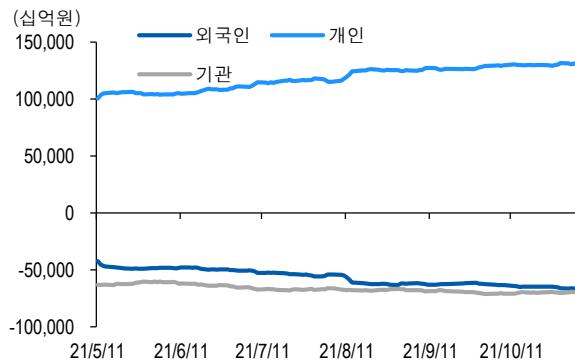
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	327.6	-25.2	302.4	0.0	146.7	801.0	-110.0	-2.0	4.0	30.0
개인	-658.6	-15.4	-674.0	0.0	1.6	-351.0	5.0	1.0	0.0	-29.0
기관	318.7	34.5	353.2	22.7	-77.9	-380.0	106.0	2.0	-3.0	-2.0
금융투자	460.9	-7.7	453.2	2.0	3.9	-651.0	106.0	2.0	-3.0	-13.0
투신	-46.6	9.3	-37.3	0.0	-4.2	285.0	0.0	0.0	0.0	27.0
은행+보험+기타금융	-10.0	42.6	32.5	0.0	-24.5	10.0	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-123.4	-1.1	-124.5	13.4	-62.3	-24.0	0.0	0.0	0.0	-15.0
기타법인	12.2	6.1	18.4	0.0	-1.2	-70.0	-1.0	0.0	-1.0	0.3

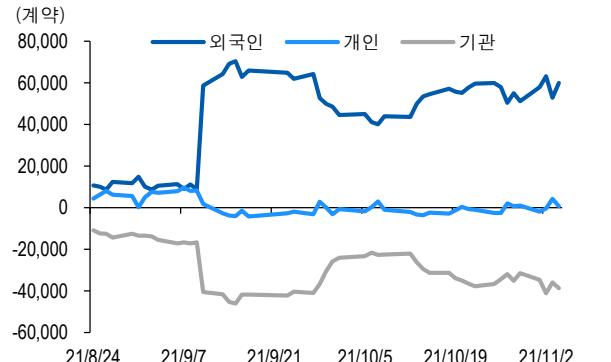
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



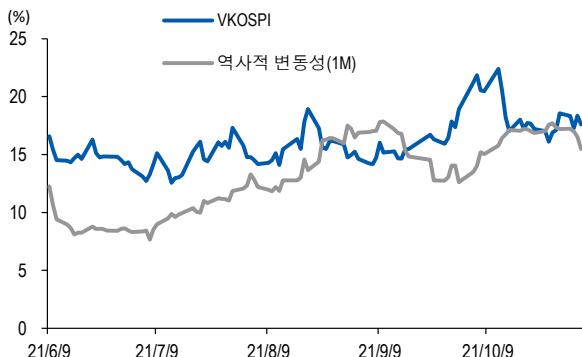
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,042,526	296.5	881,006	16.0%	지수옵션 전체	2,134,747	564.0	2,240,545
Put	1,092,221	267.5	1,359,539	16.8%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	17.60%(-0.76%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	397.5(K+3)	1.49	0.38	115,597	18,846	1,786	15.9	392.5(K+1)
	395.0(K+2)	2.36	0.63	82,403	18,659	1,007	16.4	390.0(K+0)
	392.5(K+1)	3.53	0.94	27,153	12,033	1,818	17.0	387.5(K-1)
	390.0(K+0)	4.98	1.27	12,282	14,557	1,211	17.8	385.0(K-2)
	387.5(K-1)	6.68	1.70	3,364	3,991	267	18.7	382.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	392.5(K+1)	3.89	-2.25	33,534	11,782	2,022	14.9	
	390.0(K+0)	2.84	-1.94	79,674	29,690	2,013	15.6	
	387.5(K-1)	2.04	-1.54	93,267	17,503	2,904	16.3	
	385.0(K-2)	1.45	-1.28	100,678	23,229	1,151	17.0	
	382.5(K-3)	1.00	-1.02	116,974	15,544	1,046	17.6	

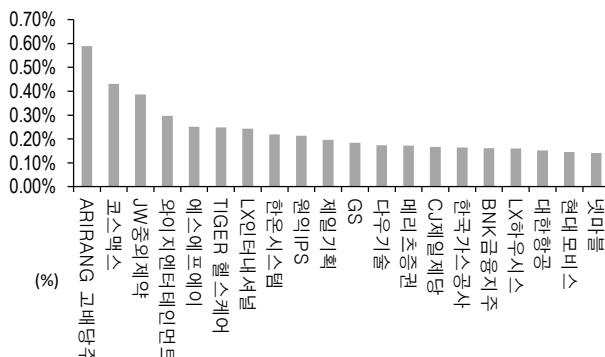
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,481,091	3,250.8	5,782,690	128,530	88,621	-35,482	-53,524	30.4	-29.2	-1.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
GS 건설	42,250	-0.94	17.9	88.6	27,837	-12,630	0.02%	2,077	-2,909	832
삼성전자	70,700	0.43	541.4	65.2	1,087,129	-79,358	0.05%	17,859	-25,332	8,149
현대모비스	252,500	-0.20	38.8	63.9	13,437	100	0.15%	74	248	-328
대한항공	30,400	0.66	24.3	63.7	136,600	17,958	0.15%	7,206	-388	-6,818
삼성전기	160,000	0.00	51.4	57.8	21,752	-2,273	-0.19%	-2,669	-9	2,690
SK 하이닉스	106,000	-0.47	117.4	53.4	102,138	-3,622	0.06%	1,894	3,962	-5,908
넥센타이어	7,650	1.59	0.5	53.3	5,370	1,216	-0.17%	871	659	-1,530
LG 화학	793,000	1.15	114.0	53.1	9,659	-249	0.08%	126	775	-901
카카오	130,500	4.40	402.9	52.2	121,721	-1,775	0.07%	2,617	7,016	-9,787
NAVER	411,500	2.49	112.1	50.9	39,313	-1,864	0.00%	628	-943	175

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터