

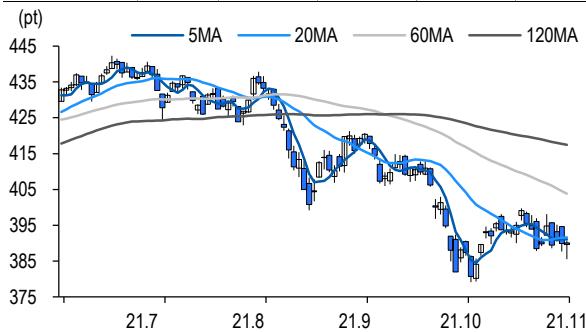


선물옵션시장 지표

2021.11.9

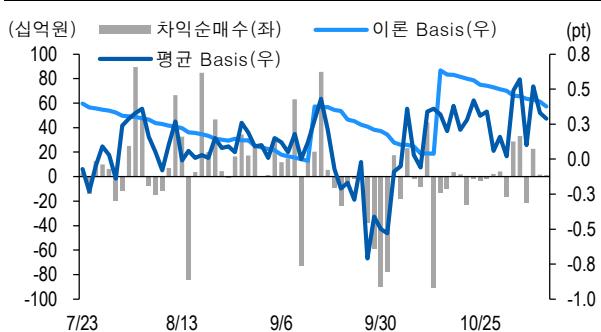
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.59	-0.07	-0.27	7,472.6	-
선물 12월물	389.95	-0.18	-0.70	24,053.5	270,072
선물 3월물	385.95	-0.18	-0.70	39.6	12,332
11월물(mini)	389.66	-0.17	-0.66	1,877.4	102,348
12월물(mini)	390.26	-0.10	-0.24	18.4	18,735



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.38	0.29	0.36	-0.02%
베이시스(mini)	0.04	-0.02	0.07	-0.01%
제1스프레드(SP)	-2.88	-3.94	-3.95	-0.27%
합성선물 베이시스(ATM)	0.04	0.10	0.10	0.02%



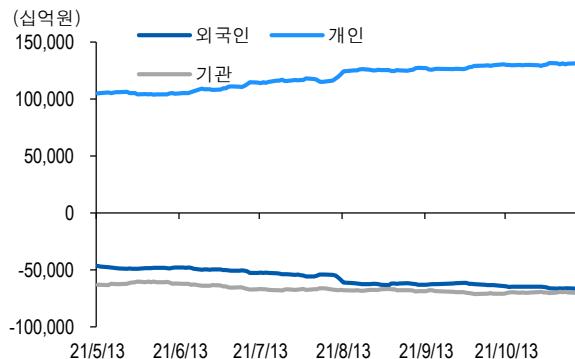
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-120.7	-42.4	-163.1	0.0	-142.0	244.6	-16.7	1.1	0.9	13.4
개인	364.5	44.9	409.4	0.0	-1.8	-3.3	-22.6	-5.0	4.3	14.7
기관	-273.4	8.9	-264.5	1.4	-52.1	-270.4	39.2	1.9	-5.0	-29.3
금융투자	4.0	45.2	49.1	-0.2	0.3	-389.8	39.2	2.9	-4.5	-18.6
투신	-62.0	12.2	-49.7	0.0	0.2	118.7	0.0	-0.7	0.2	-14.4
은행+보험+기타금융	6.2	-50.7	-44.6	-0.2	3.2	2.8	0.0	-0.4	-0.7	0.3
연기금+국가지자체	-92.9	-4.2	-97.0	1.7	-53.5	-2.1	0.0	0.0	0.0	3.4
기타법인	29.5	-11.4	18.2	0.0	-1.5	29.1	0.1	2.1	-0.2	1.2

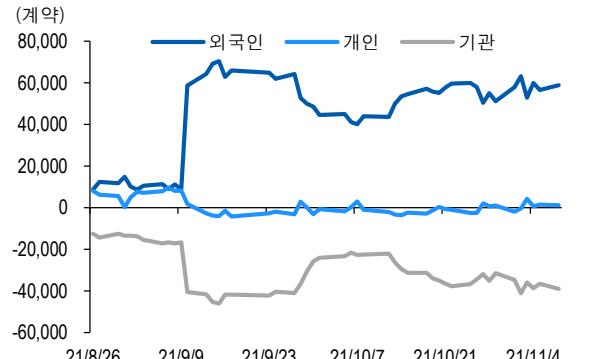
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,706,309	327.7	962,919	18.1%	지수옵션 전체	3,498,121	739.5	2,419,764
Put	1,791,812	411.8	1,456,845	19.6%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	18.24% (+0.22%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	397.5(K+3)	0.54	-0.39	243,313	24,403	1,081	17.9	392.5(K+1)
	395.0(K+2)	1.01	-0.57	281,325	25,355	3,657	18.0	390.0(K+0)
	392.5(K+1)	1.76	-0.75	206,805	17,391	3,563	18.2	387.5(K-1)
	390.0(K+0)	2.85	-0.88	148,330	20,008	2,815	18.6	385.0(K-2)
	387.5(K-1)	4.26	-0.97	57,177	7,658	2,640	18.9	382.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	392.5(K+1)	4.58	-0.15	4,941	11,753	-405	17.9	390.0(K+0)
	390.0(K+0)	3.16	-0.30	28,844	27,806	-1,290	18.3	387.5(K-1)
	387.5(K-1)	2.10	-0.39	70,772	16,466	-707	18.8	385.0(K-2)
	385.0(K-2)	1.34	-0.40	159,381	25,241	521	19.3	382.5(K-3)
	382.5(K-3)	0.82	-0.36	199,397	18,177	1,180	19.8	

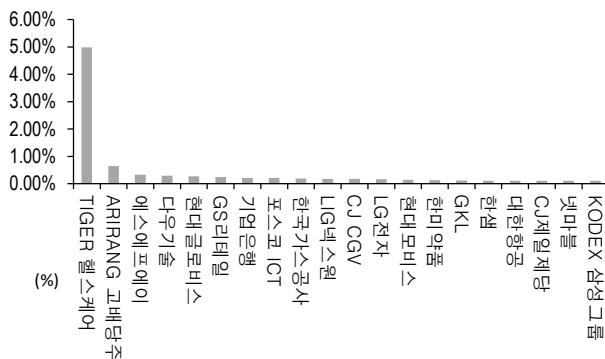
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,575,063	2,809.5	5,875,696	69,604	77,690	8,294	-87,926	13.4	14.7	-29.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
GS 건설	42,250	1.44	12.2	90.3	22,375	-2,932	0.05%	1,313	98	-1,411
LG 생활건강	1,222,000	-0.24	20.4	74.7	1,127	30	-0.08%	57	16	-73
NAVER	408,500	-0.49	96.3	70.9	32,811	-6,472	-0.02%	-480	-1,454	1,972
삼성전자	70,500	-0.14	483.8	62.9	917,740	-164,293	0.04%	623	6,987	-8,635
SK 하이닉스	108,000	1.41	144.1	61.7	97,433	-1,802	-0.08%	3,274	-991	-2,543
삼성 SDI	745,000	-1.06	63.0	60.0	19,550	-808	0.00%	-1,034	634	397
현대차	215,500	0.23	67.6	59.7	44,762	-290	0.03%	942	1,121	-2,063
카카오	126,000	-2.33	290.3	57.8	102,594	-12,350	0.02%	-310	-299	819
현대모비스	252,000	0.00	30.0	57.0	12,190	-1,440	0.14%	631	-1,259	628
현대미포조선	75,500	-1.31	11.6	56.2	8,708	-4,298	-0.26%	-152	717	-565

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터