

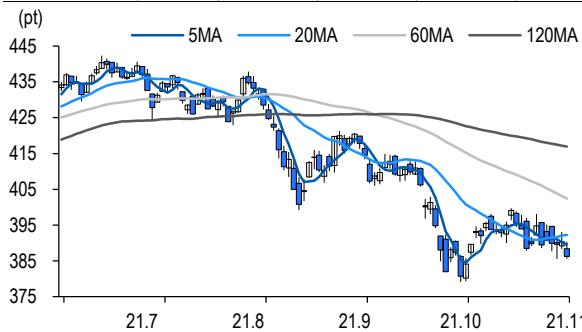


선물옵션시장 지표

2021.11.11

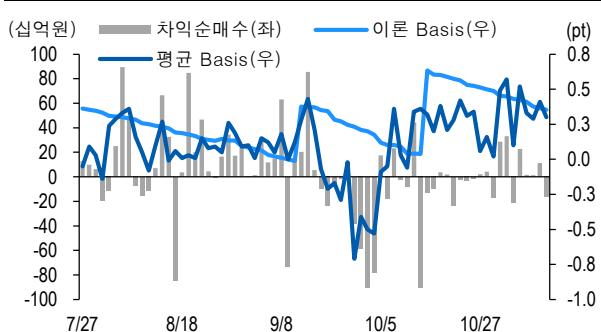
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	386.24	-1.06	-4.12	6,807.9	-
선물 12월물	386.45	-1.04	-4.05	26,501.4	273,760
선물 3월물	382.45	-1.06	-4.10	62.5	12,425
11월물(mini)	386.10	-1.04	-4.04	2,039.8	102,158
12월물(mini)	386.60	-1.00	-3.92	57.5	21,427



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.35	0.30	0.21	-0.01%
베이시스(mini)	0.01	-0.02	-0.14	-0.01%
제1스프레드(SP)	-2.87	-3.94	-3.95	-0.28%
합성선물 베이시스(ATM)	0.01	-0.13	-0.13	-0.04%

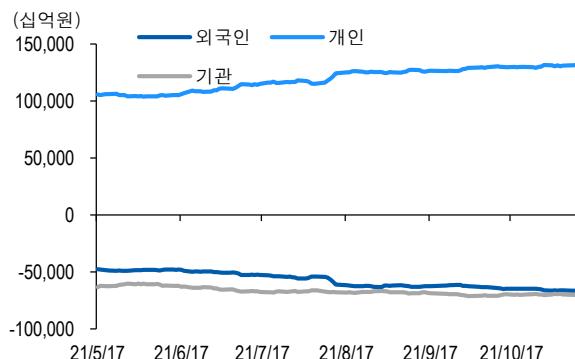


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-20.8	-44.0	-64.8	-2.3	-151.9	-482.0	41.5	-1.6	-3.2	-11.4
개인	234.5	248.3	482.9	0.0	-2.8	344.1	-0.8	0.6	1.4	-5.5
기관	-235.1	-184.2	-419.3	-14.1	1.0	67.6	-41.2	-0.2	1.2	16.6
금융투자	-74.2	-275.4	-349.7	-0.3	8.8	369.9	-41.2	0.9	0.3	-27.1
투신	-43.7	-2.5	-46.2	0.0	-0.5	-326.8	0.2	-0.4	0.1	23.9
은행+보험+기타금융	2.8	100.0	102.8	-0.5	-2.1	10.1	0.0	-0.8	0.9	0.0
연기금+국가지자체	-91.1	-1.9	-93.0	-13.4	0.0	14.4	-0.2	0.0	0.0	19.8
기타법인	21.4	-20.2	1.2	0.0	-0.6	70.3	0.5	1.2	0.7	0.3

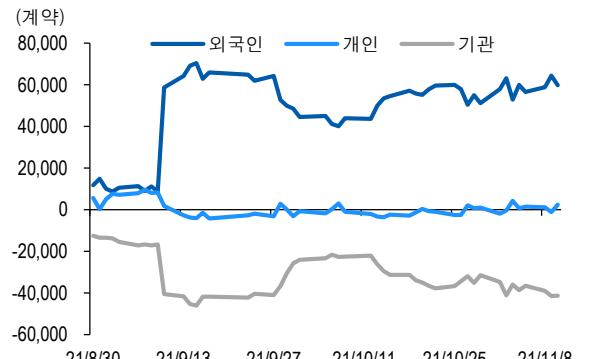
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



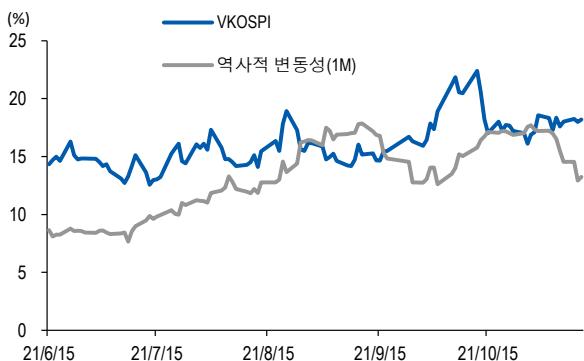
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	2,008,806	277.3	1,085,742	14.7%	지수옵션 전체	4,169,156	668.0	2,638,667						
Put	2,160,350	390.8	1,552,925	16.6%	PCR(금액기준)	1.41	VKOSPI	18.19% (+0.19%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	397.5(K+3)	0.01	-0.28	233,633	35,471	6,780	15.7	392.5(K+1)	6.45	2.65	15,073	11,572	-844	16.6
	395.0(K+2)	0.03	-0.65	453,747	39,045	9,474	14.6	390.0(K+0)	4.25	1.85	85,194	28,416	410	15.7
	392.5(K+1)	0.09	-1.31	433,183	30,600	11,214	13.5	387.5(K-1)	2.49	1.05	197,070	17,324	-746	15.8
	390.0(K+0)	0.36	-2.14	344,191	33,104	11,065	13.7	385.0(K-2)	1.26	0.44	376,593	24,570	-3,101	16.0
	387.5(K-1)	1.14	-2.91	159,120	16,097	8,531	14.8	382.5(K-3)	0.57	0.12	416,875	25,178	3,709	16.6

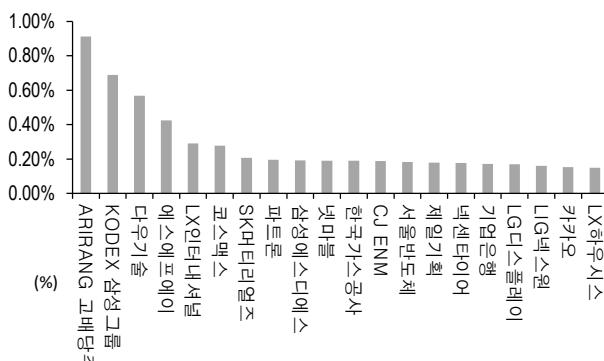
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,754,749	2,955.3	5,809,744	-28,143	14,735	193	-15,363	-11.4	-5.5	16.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
호텔신라	81,100	-1.93	26.2	83.6	19,485	-6,919	0.12%	-1,050	-191	1,241
BNK 금융지주	8,480	-0.12	7.9	81.6	15,883	-57,086	0.04%	7,131	-526	-6,604
삼성 SDI	746,000	-0.27	90.4	76.2	5,483	-4,722	0.00%	194	-498	304
NAVER	414,500	-0.84	114.3	70.0	16,096	-16,433	0.02%	-247	-977	1,209
삼성전자	70,300	-0.42	448.0	67.7	593,994	-168,304	0.06%	557	16,064	-17,109
KT	31,000	0.32	13.0	60.5	19,941	-26,508	-0.11%	7,743	-7,215	-377
대한항공	30,400	-1.62	21.9	56.1	104,308	-27,900	0.05%	826	-5,642	4,816
카카오	124,500	-1.58	105.9	53.9	76,406	-18,199	0.15%	-1,984	1,726	338
현대차	208,000	-2.35	70.8	50.2	33,649	-6,469	-0.13%	2,016	257	-2,263
LG 이노텍	217,000	1.64	23.0	49.5	4,906	-1,259	-0.02%	838	-534	-299

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터