

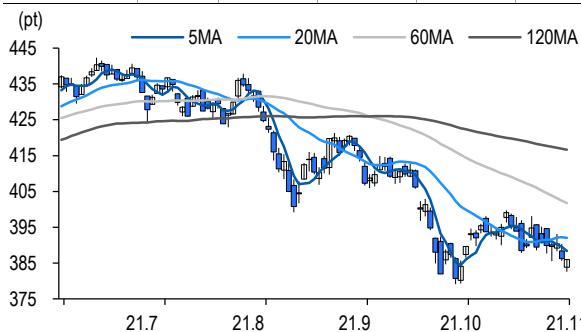


선물옵션시장 지표

2021.11.12

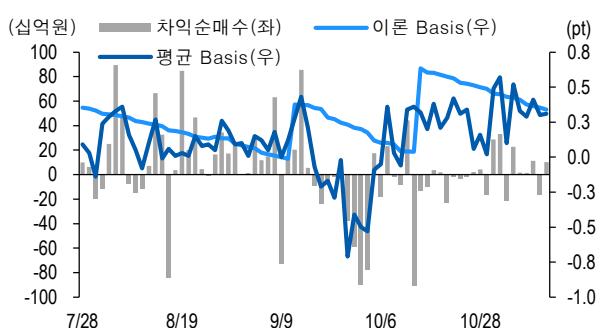
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	385.97	-0.07	-0.27	11,010.1	-
선물 12월물	386.55	0.03	0.10	25,440.6	277,619
선물 3월물	382.70	0.07	0.25	44.6	12,656
11월물(mini)	385.80	-0.08	-0.30	1,509.1	0
12월물(mini)	386.62	0.04	0.02	879.1	27,590



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.34	0.31	0.58	-0.01%
베이시스(mini)	0.00	-0.04	-0.17	-0.01%
제1스프레드(SP)	-2.88	-3.89	-3.90	-0.26%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	-0.15	-0.15	-0.04%



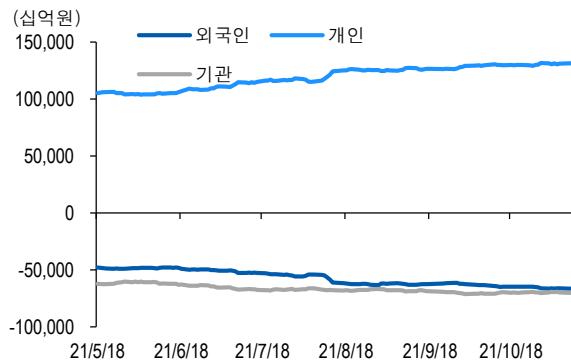
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	90.2	19.2	109.4	8.4	99.2	237.1	77.0	0.6	7.4	39.2
개인	144.6	65.7	210.2	0.0	-1.6	-321.2	-54.8	-0.2	-2.3	-51.2
기관	-241.4	-89.3	-330.7	1.8	89.8	67.4	-34.7	-0.7	-3.8	13.7
금융투자	2.6	-75.6	-72.9	5.9	151.3	19.0	-60.7	2.6	-3.9	33.6
투신	-62.5	15.5	-47.1	0.0	-22.3	54.6	-1.2	-1.6	0.1	18.3
은행+보험+기타금융	12.1	-19.3	-7.1	-0.2	-1.3	-9.0	27.3	-1.6	0.0	0.3
연기금+국가지자체	-141.0	-2.0	-142.9	-3.9	-18.1	2.9	0.0	-0.1	0.1	-38.6
기타법인	6.6	4.4	11.1	0.0	-1.3	16.6	12.5	0.3	-1.3	-1.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

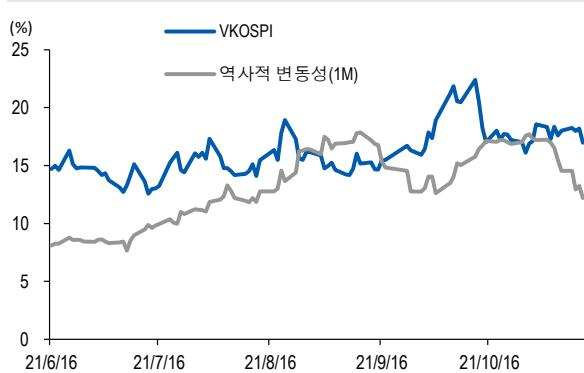




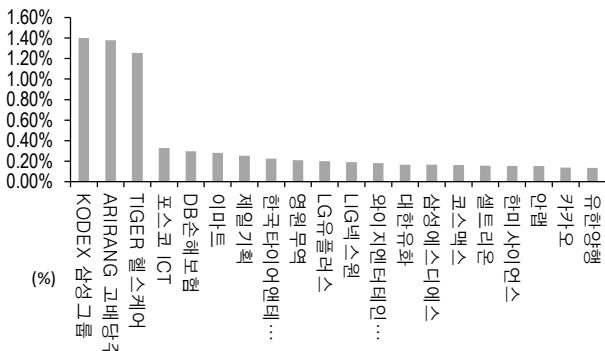
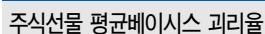
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향									(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	2,099,593	274.0	524,100	6.6%	지수옵션 전체	4,414,853	581.6	1,499,376							
Put	2,315,260	307.6	975,276	11.1%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	16.98%(-1.21%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	392.5(K+3)	0.01	-0.08	85,016	0	-30,600	13.8	Put	387.5(K+1)	1.70	-0.79	62,567	0	-17,324	8.6
	390.0(K+2)	0.01	-0.35	257,591	0	-33,104	9.1		385.0(K+0)	0.10	-1.16	390,762	0	-24,570	5.2
	387.5(K+1)	0.02	-1.12	705,297	0	-16,097	4.6		382.5(K-1)	0.01	-0.56	595,005	0	-25,178	8.2
	385.0(K+0)	0.92	-1.50	648,886	0	-7,675	5.4		380.0(K-2)	0.01	-0.25	494,301	0	-37,448	13.1
	382.5(K-1)	3.34	-0.91	175,363	0	-1,856	11.3		377.5(K-3)	0.01	-0.11	275,698	0	-33,276	17.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현매출 상위 10종목)										(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,942,604	3,890.5	4,341,548	-1,468,196	57,952	-13,236	-43,447	39.2	-51.2	13.7		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현매출 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균과리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
셀트리온헬스케어	85,800	1.30	43.1	67.5	0	-44,182	0.04%	-4,084	-197	4,328	-7,059	0
아모레퍼시픽	181,500	1.11	28.3	58.0	0	-14,589	0.05%	71	-598	527	-1,338	-445
대한항공	30,850	1.48	32.3	43.6	0	-104,308	-0.04%	1,815	-5,329	3,514	28,393	4,765
셀트리온	212,000	-0.93	61.0	42.7	0	-18,725	0.16%	-2,008	3,485	-1,527	-3,716	0
SK 하이닉스	107,500	-0.92	110.8	38.0	0	-79,492	0.01%	-2,243	13,374	-10,908	-2,218	-7,632
아모레 G	47,900	-0.52	2.6	37.2	0	-8,083	0.03%	-448	27	421	-512	-455
OCI	116,000	0.43	12.1	36.0	0	-7,444	0.05%	1,065	-350	-698	67	-765
호텔신라	80,600	-0.62	9.9	32.8	0	-19,485	0.09%	996	-628	-376	1,572	-1,122
한국조선해양	99,200	0.00	7.1	32.2	0	-7,735	0.02%	1,359	-225	-1,133	373	-1,481
LG 디스플레이	20,250	0.50	15.2	30.9	0	-100,110	0.09%	19,438	-638	-18,631	-3,317	-16,825

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터