

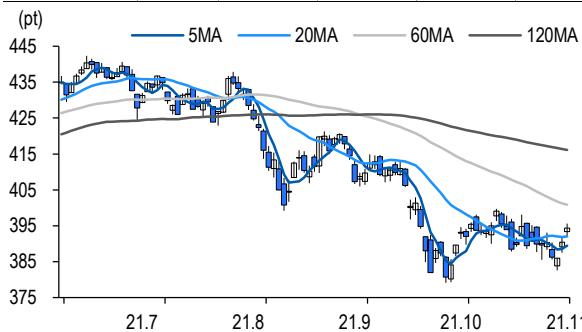


## 선물옵션시장 지표

2021.11.16

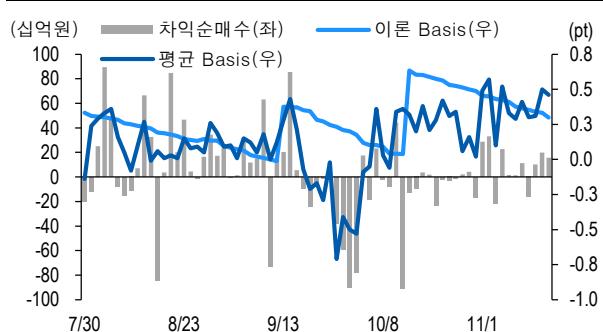
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.36	1.02	3.98	8,387.4	-
선물 12월물	395.30	1.06	4.15	16,730.9	283,677
선물 3월물	391.30	1.06	4.10	41.8	11,606
12월물(mini)	394.98	0.98	3.86	1,533.8	35,094
1월물(mini)	390.76	1.11	4.28	4.0	646



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.30	0.46	0.94	0.04%
베이시스(mini)	0.30	0.45	0.62	0.04%
제1스프레드(SP)	-2.84	-3.92	-4.00	-0.27%
합성선물 베이시스(ATM)	0.30	0.93	0.93	0.16%

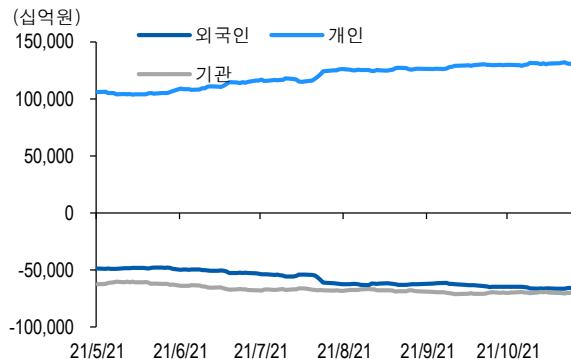


## 투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	398.0	-44.0	354.0	0.1	289.6	185.3	75.8	-3.0	-0.9	-5.1
개인	-814.3	303.4	-510.9	0.0	-13.3	-114.4	-55.9	2.4	-1.8	18.3
기관	415.4	-268.4	147.0	15.5	-20.6	-49.6	-8.4	0.4	3.0	-19.4
금융투자	409.5	-269.4	140.1	19.5	-1.6	-156.1	-12.5	0.2	3.1	2.2
투신	-24.3	5.2	-19.1	0.0	-9.3	100.1	3.9	0.0	-0.1	20.6
은행+보험+기타금융	-3.2	-13.6	-16.8	-0.2	-7.0	7.8	0.2	0.2	0.0	1.3
연기금+국가지자체	46.9	3.5	50.3	-3.8	3.8	-1.4	0.0	0.0	0.0	-43.4
기타법인	0.9	9.0	9.9	0.0	0.2	-21.4	-11.4	0.2	-0.3	6.1

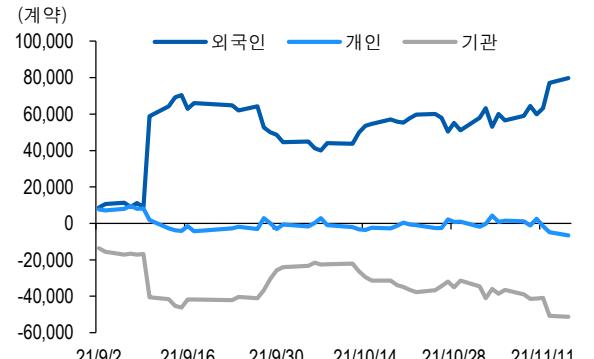
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이





## 선물옵션시장 지표

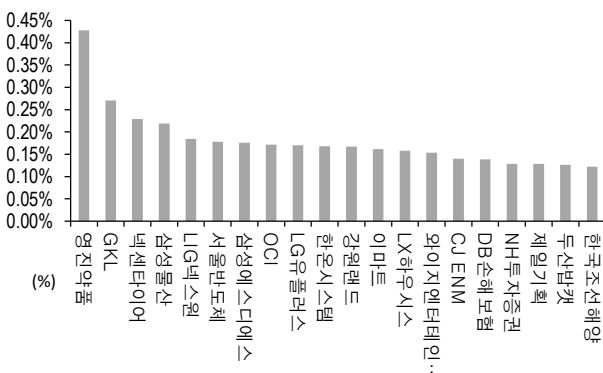
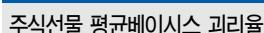
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	486,775	170.9	606,303	14.7%	지수옵션 전체		975,781	293.0	1,785,647						
Put	489,006	122.1	1,179,344	15.5%	PCR(금액기준)		0.71	VKOSPI	15.90%(-0.28%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	4.79	1.44	11,088	4,187	38	14.8	Put	392.5(K+1)	4.83	-2.13	3,737	2,175	723	14.2
	395.0(K+2)	6.04	1.69	7,984	8,738	139	15.1		390.0(K+0)	3.92	-1.89	8,989	14,130	702	14.6
	392.5(K+1)	7.57	2.03	2,721	3,696	-144	15.7		387.5(K-1)	3.23	-1.62	11,095	3,919	1,067	15.1
	390.0(K+0)	9.21	2.31	2,679	9,012	123	16.2		385.0(K-2)	2.58	-1.42	20,938	9,529	1,883	15.4
	387.5(K-1)	10.70	2.24	882	3,026	-11	15.9		382.5(K-3)	2.13	-1.17	18,258	4,351	1,756	16.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센-



---

자료: KBX 유파티<sup>증권</sup> 리서치센터



---

자료: KBX 유티즌워리리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)										(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	2,604,986	2,477.9	4,874,448	170,353	-28,663	41,739	-18,045	-5.1	18.3	-19.4		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	409,500	0.12	81.9	60.2	45,311	-2,730	-0.15%	1,125	-6,937	5,894	5,351	430
현대차	209,000	0.48	45.7	58.3	38,158	1,869	0.05%	-586	645	-49	2,259	-2,308
기아	86,800	-0.12	57.2	56.9	51,316	1,105	0.00%	-1,866	2,341	-505	1,653	-2,136
삼성전자	71,600	1.42	501.6	56.7	1,234,256	46,482	0.09%	-6,938	15,655	-9,949	-2,109	-23,900
SK 머티리얼즈	389,600	-0.08	2.8	55.4	1,050	78	-0.04%	-4	86	-82	-78	0
SK	248,000	0.61	24.9	54.0	12,607	67	-0.05%	34	-874	840	512	388
LG 이노텍	256,500	5.99	75.9	45.6	9,673	255	-0.05%	206	-483	277	1,151	-729
현대모비스	247,500	1.64	23.0	45.0	8,063	751	0.07%	1,098	-227	-871	-210	-661
SK 하이닉스	110,500	3.76	230.8	44.4	104,362	12,086	0.06%	-657	2,450	-2,293	-5,005	-2,700
현대제철	41,800	0.60	6.1	44.3	18,682	1,397	0.00%	-723	-320	1,043	1,879	-836

자료: KBX 유파티<sup>증권</sup> 리서치센터