

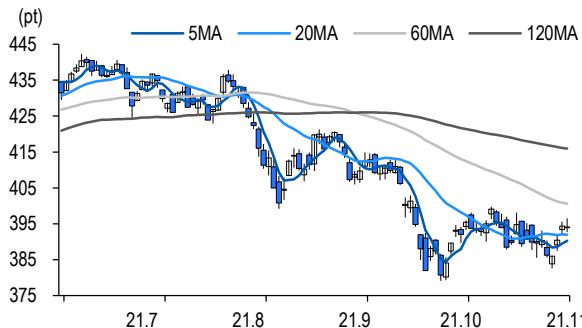


선물옵션시장 지표

2021.11.17

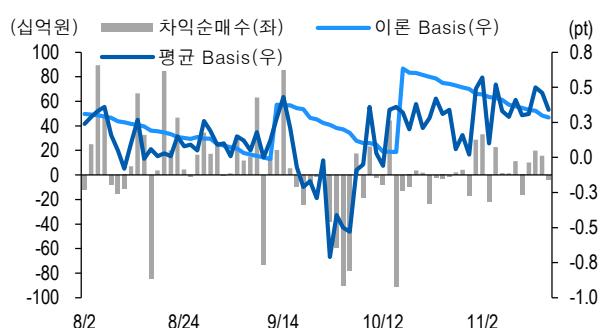
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.07	-0.07	-0.29	7,683.4	-
선물 12월물	394.60	-0.18	-0.70	18,485.6	283,089
선물 3월물	390.50	-0.20	-0.80	37.0	11,564
12월물(mini)	394.64	-0.17	-0.34	1,758.6	35,868
1월물(mini)	390.32	-0.11	-0.44	2.2	777



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.29	0.34	0.53	0.01%
베이시스(mini)	0.29	0.34	0.57	0.01%
제1스프레드(SP)	-2.85	-4.00	-4.00	-0.29%
합성선물 베이시스(ATM)	0.29	0.47	0.47	0.05%



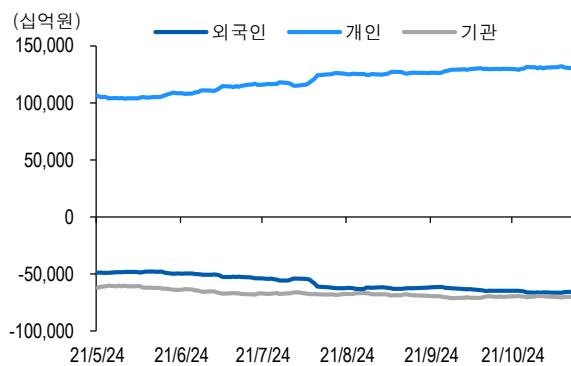
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	240.9	2.9	243.8	0.0	240.2	57.5	-17.3	-2.4	0.1	-2.3
개인	-145.7	208.8	63.2	0.0	-21.6	94.8	34.0	1.2	-2.0	45.8
기관	-109.3	-208.5	-317.7	-3.6	-68.9	-166.6	-18.4	1.4	2.0	-43.8
금융투자	76.9	-208.1	-131.2	4.7	0.8	243.0	-18.3	1.4	2.0	-49.3
투신	-47.3	-7.7	-55.0	0.0	-14.5	-380.8	0.0	0.0	0.0	27.1
은행+보험+기타금융	-3.1	15.6	12.4	-0.5	0.4	-33.9	-0.2	0.0	0.0	-0.7
연기금+국가지자체	-97.6	-4.9	-102.4	-7.8	-46.3	5.1	0.0	0.0	0.0	-20.9
기타법인	14.1	-3.2	10.8	0.0	-0.7	14.3	1.8	-0.2	-0.1	0.2

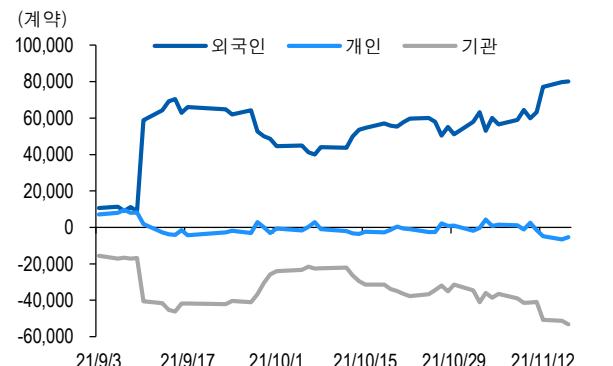
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	464,444	158.9	631,418	13.7%	지수옵션 전체	911,871	299.5	1,860,516
Put	447,427	140.6	1,229,098	15.1%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	15.97%(+0.07%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	2.42	-0.33	37,591	12,141	654	13.7	Put	397.5(K+1)	7.36	0.27	2,046	1,440	539	14.0
	400.0(K+2)	3.28	-0.36	27,291	16,329	40	13.9		395.0(K+0)	6.02	0.14	5,217	4,046	1,171	14.1
	397.5(K+1)	4.34	-0.45	9,889	5,102	915	14.3		392.5(K-1)	4.95	0.12	5,281	2,415	240	14.5
	395.0(K+0)	5.56	-0.48	8,500	9,226	488	14.6		390.0(K-2)	4.03	0.11	12,277	14,728	598	14.9
	392.5(K-1)	7.02	-0.55	2,607	3,722	26	15.0		387.5(K-3)	3.28	0.05	17,960	4,926	1,007	15.3

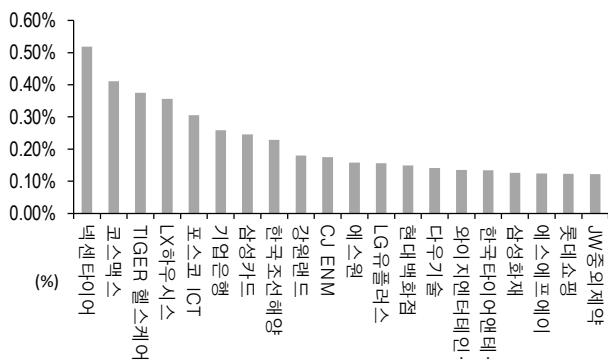
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,777,893	2,537.7	4,951,740	77,292	3,576	49,369	-53,173	-2.3	45.8	-43.8

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
LG 이노텍	268,500	4.68	113.4	69.3	9,681	8	-0.12%	396	-1,006	610	820	-85
삼성전자	71,500	-0.14	508.8	65.2	1,256,170	21,914	0.05%	-17,337	18,509	-1,390	3,275	-571
SK 하이닉스	112,000	1.36	259.7	61.8	101,424	-2,938	-0.17%	3,869	-6,216	2,387	2,337	50
카카오	127,000	-1.55	123.1	61.4	108,237	2,546	0.00%	5,170	-10	-5,160	-5,325	-3,865
LG 디스플레이	20,700	-0.24	26.5	58.5	299,751	1,189	-0.35%	-12,193	9,072	3,606	1,051	2,702
삼성 SDI	761,000	1.06	89.2	58.4	26,961	1,885	0.01%	-99	1,823	-1,724	-715	-1,009
롯데케미칼	216,000	-1.37	11.8	51.5	4,181	-77	0.06%	126	54	-180	-360	180
셀트리온	230,500	-1.07	115.7	50.2	35,261	-6,831	0.10%	486	4,661	-5,167	-10,823	0
포스코케미칼	146,500	0.00	13.1	48.6	12,191	1,459	-0.03%	197	1,680	-1,877	-1,434	-443
GS 건설	41,650	-1.19	6.3	48.3	35,303	-1,516	0.00%	147	-871	709	789	-80

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터