

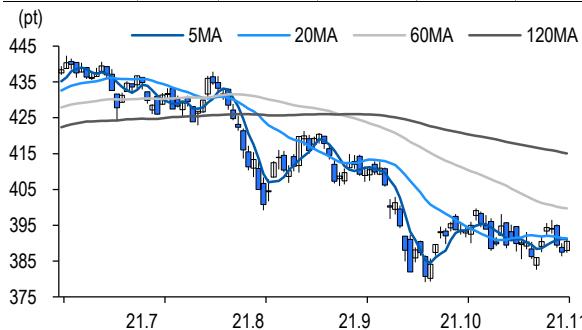


## 선물옵션시장 지표

2021.11.22

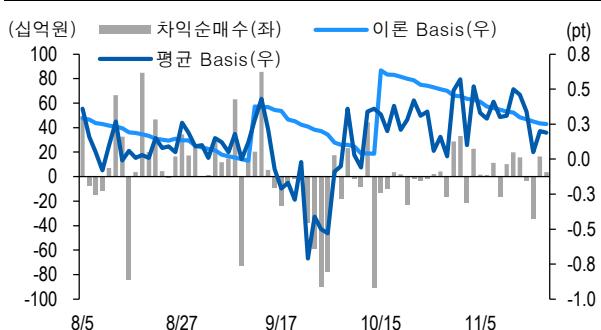
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	390.53	0.80	3.09	7,886.5	-
선물 12월물	390.85	0.64	2.50	22,011.6	281,300
선물 3월물	386.95	0.68	2.60	45.2	11,271
12월물(mini)	390.88	0.65	2.58	2,024.6	44,456
1월물(mini)	386.30	0.65	2.48	3.9	895



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.25	0.19	0.32	-0.02%
베이시스(mini)	0.25	0.19	0.35	-0.02%
제1스프레드(SP)	-2.86	-3.96	-3.95	-0.28%
합성선물 베이시스(ATM)	0.25	0.24	0.24	0.00%



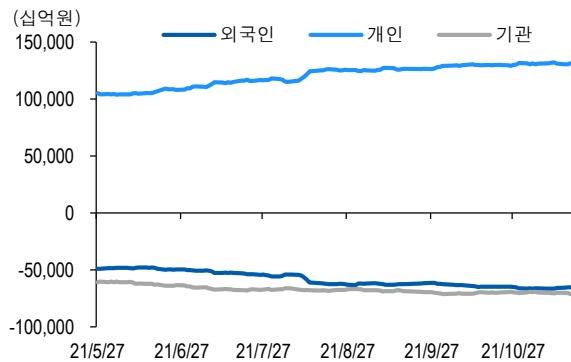
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	231.1	6.5	237.6	-2.0	142.2	167.0	23.0	1.4	-3.8	-7.2
개인	-352.5	59.5	-293.1	0.0	-0.1	-143.8	-27.4	-1.7	2.9	38.3
기관	74.9	-68.2	6.7	5.7	-67.7	27.8	6.0	0.1	1.1	-29.9
금융투자	124.4	-149.5	-25.2	-0.2	-17.6	-277.0	6.6	0.1	1.1	-10.2
투신	-13.6	3.2	-10.4	0.0	-6.5	311.4	0.0	0.1	0.0	-0.9
은행+보험+기타금융	-14.1	69.0	54.9	0.0	-9.1	-2.4	-0.6	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가지자체	-12.7	3.4	-9.3	5.9	-27.7	-4.2	0.0	0.0	0.0	-18.6
기타법인	46.5	2.3	48.7	0.0	0.5	-51.1	-1.6	0.1	-0.2	-1.2

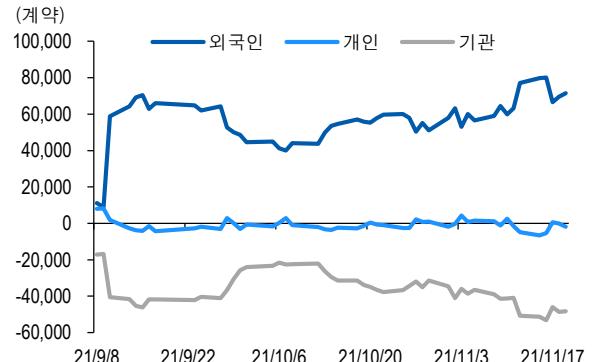
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



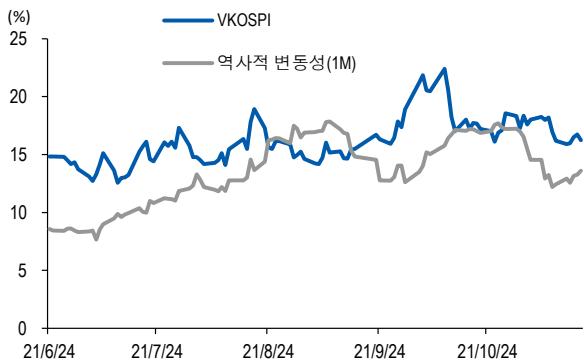
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	638,353	208.4	711,733	14.1%	지수옵션 전체	1,189,842	382.5	2,036,745						
Put	551,489	174.1	1,325,012	16.3%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	16.25%(-0.49%p)						
<hr/>														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	395.0(K+3)	3.48	0.62	52,071	11,682	857	14.2	Put						
	392.5(K+2)	4.62	0.77	14,804	5,104	472	14.5	390.0(K+1)	5.15	-1.48	5,942	15,106	473	14.8
	390.0(K+1)	5.96	0.99	10,205	10,751	636	14.9	387.5(K+0)	4.20	-1.27	6,686	5,957	214	15.3
	387.5(K+0)	7.47	1.13	3,228	3,565	132	15.3	385.0(K-1)	3.37	-1.11	13,483	12,061	499	15.7
	385.0(K-1)	9.06	1.30	2,161	3,392	163	15.4	382.5(K-2)	2.70	-0.95	19,451	9,835	47	16.1
<hr/>														
380.0(K-3)														

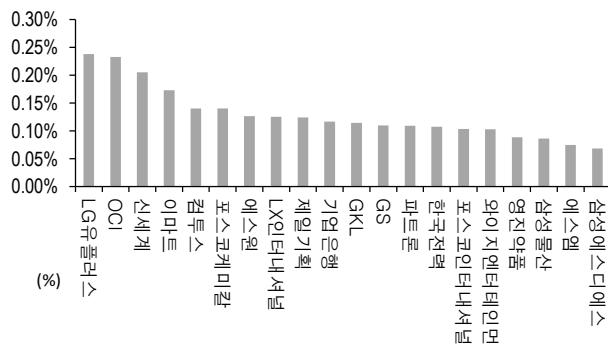
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,195,652	2,565.2	5,049,725	87,097	31,877	35,064	-62,989	-7.2	38.3	-29.9	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
LG 이노텍	289,000	1.05	91.3	76.2	8,747	-620	-0.04%	-942	618	324	620
삼성전자	71,300	1.28	639.6	75.9	1,173,429	37,387	0.03%	-4,133	25,640	-21,413	-11,245
삼성 SDI	754,000	-1.05	88.4	68.4	27,778	-307	0.00%	-937	846	91	-12
현대제철	40,450	0.50	13.2	64.2	19,521	-686	0.01%	1,358	1,351	-2,709	-2,435
엔씨소프트	752,000	-1.18	119.0	54.9	11,083	329	-0.03%	311	-283	-31	157
기아	84,100	1.33	63.1	54.0	54,021	130	0.02%	-1,172	-909	2,081	-1,065
SK	246,000	-0.40	20.1	49.4	11,917	456	0.01%	637	-32	-605	118
POSCO	278,500	1.09	37.4	47.1	15,905	34	-0.03%	-31	-36	117	-239
한국항공우주	30,700	1.99	5.8	46.5	10,633	-5,594	0.00%	2,531	-796	-1,735	-6,545
SK 하이닉스	112,000	1.82	119.5	46.3	93,912	-1,563	0.04%	-2,742	4,497	-1,705	-1,213

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터