

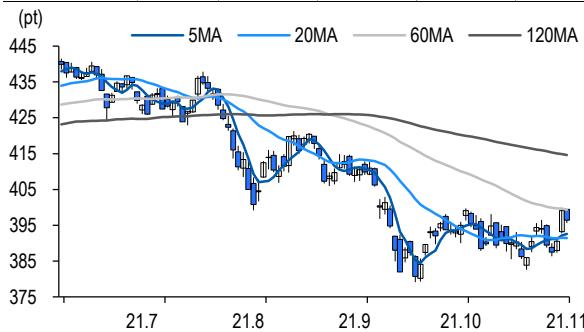


선물옵션시장 지표

2021.11.24

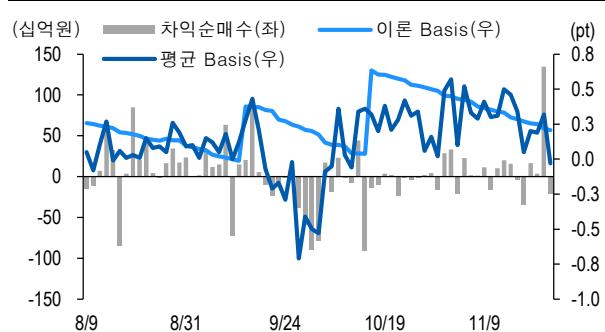
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	396.44	-0.66	-2.63	7,956.3	-
선물 12월물	396.05	-0.99	-3.95	20,997.5	283,836
선물 3월물	392.20	-0.88	-3.50	52.4	11,546
12월물(mini)	396.10	-0.98	-3.86	1,671.2	46,600
1월물(mini)	391.88	-0.95	-3.76	5.8	1,077



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.21	-0.03	-0.39	-0.06%
베이시스(mini)	0.21	-0.03	-0.34	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.81	-3.91	-3.95	-0.28%
합성선물 베이시스(ATM)	0.21	-0.35	-0.35	-0.14%



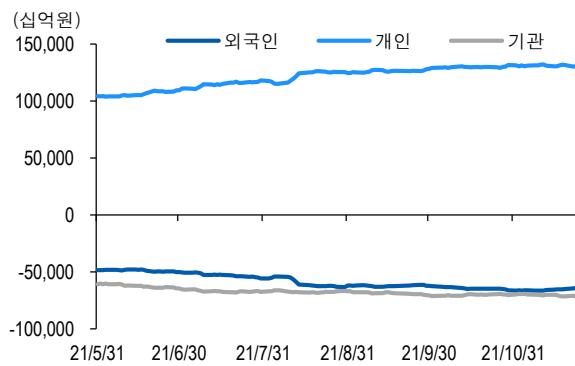
투자주체별 매매 동향

(십억원)

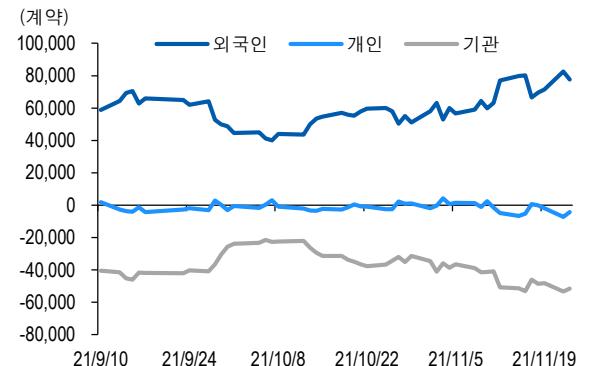
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	279.4	15.8	295.2	9.7	-82.4	-418.3	-87.9	-1.8	-1.3	-20.6
개인	380.4	109.6	490.0	0.0	2.3	213.3	81.4	1.9	-2.0	-23.5
기관	-696.1	-118.0	-814.1	-31.0	-51.9	171.5	-1.3	0.0	3.6	45.5
금융투자	-562.5	-191.7	-754.2	-12.7	6.2	597.4	-1.2	0.3	2.8	3.1
투신	-101.4	-21.4	-122.8	0.0	-58.0	-422.5	-0.1	-0.4	0.0	-8.0
은행+보험+기타금융	2.1	90.9	93.0	-0.4	-6.0	-18.9	-0.1	0.0	0.8	1.0
연기금+국가지자체	-26.6	-0.1	-26.7	-17.9	12.7	15.6	0.0	0.0	0.0	49.4
기타법인	36.3	-7.3	29.0	0.0	0.4	33.6	7.8	-0.1	-0.2	-1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

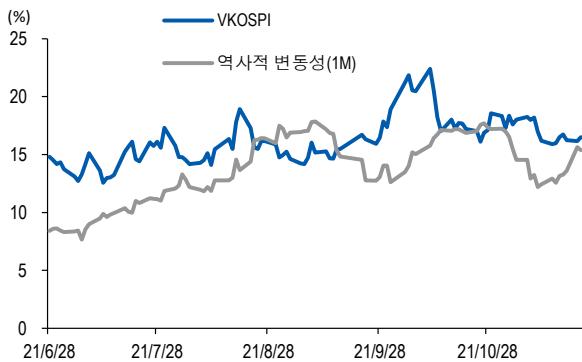
지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	641,184	195.5	759,069	13.6%	지수옵션 전체	1,279,225	406.3	2,197,951
Put	638,041	210.7	1,438,882	16.3%	PCR(금액기준)	1.08	VKOSPI	16.50% (+0.33%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	407.5(K+3)	1.14	-0.84	80,114	16,925	1,300	13.6	Put	402.5(K+1)	8.62	1.85	997	724	188	15.1
	405.0(K+2)	1.68	-1.06	72,897	22,870	19	13.7		400.0(K+0)	7.18	1.95	4,270	14,112	974	15.6
	402.5(K+1)	2.41	-1.36	42,330	17,169	205	13.9		397.5(K-1)	5.80	1.60	7,830	3,547	-331	15.7
	400.0(K+0)	3.27	-1.75	28,297	24,260	-1,758	13.9		395.0(K-2)	4.65	1.30	15,820	5,965	510	16.0
	397.5(K-1)	4.38	-2.13	8,958	10,609	-66	14.0		392.5(K-3)	3.69	1.06	26,817	4,543	811	16.3

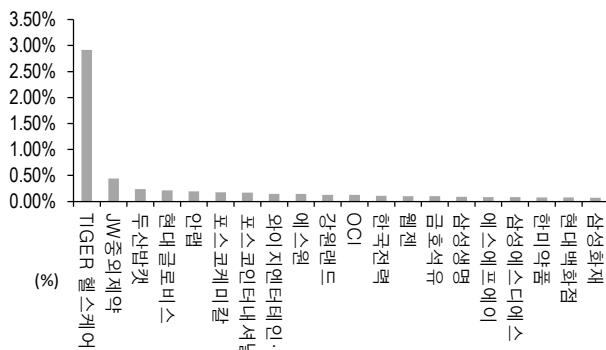
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,532,427	3,064.4	5,043,269	-123,337	-29,135	-58,399	87,796	-20.6	-23.5	45.5		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대한항공	29,050	-1.19	27.0	72.2	76,351	-4,491	-0.17%	-4,658	-1,200	5,858	28,139	3,798
LG 이노텍	277,000	-3.15	91.3	68.2	10,205	1,672	0.04%	830	1,011	-1,841	-492	-727
SK 하이닉스	119,000	0.00	388.1	67.7	115,287	-14,314	-0.05%	-2,767	664	2,130	8,315	-4,300
현대차	215,000	-1.60	115.2	65.5	42,697	-3,846	0.04%	-1,943	-650	2,593	-388	3,281
POSCO	286,000	1.42	68.6	61.6	17,253	1,730	-0.02%	556	-1,347	760	-1,580	-207
삼성전자	75,300	0.40	980.0	59.6	1,171,780	-68,522	0.00%	-31,698	-28,782	60,306	10,004	46,097
엔씨소프트	707,000	-5.61	135.6	57.2	9,509	-1,592	0.06%	407	-490	83	68	898
LG 전자	127,500	-4.85	78.3	46.0	29,907	3,524	0.01%	-951	6,147	-5,216	-3,807	-1,409
기아	83,700	-2.56	62.3	45.2	56,730	-262	0.00%	-2,622	310	2,302	-2,523	4,393
SK	244,500	-1.41	14.5	44.7	12,179	571	0.06%	283	304	-587	-53	-534

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터