

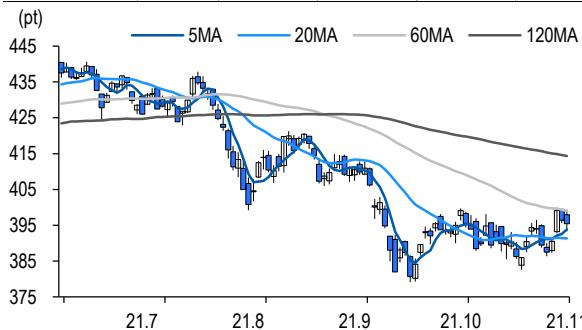


선물옵션시장 지표

2021.11.25

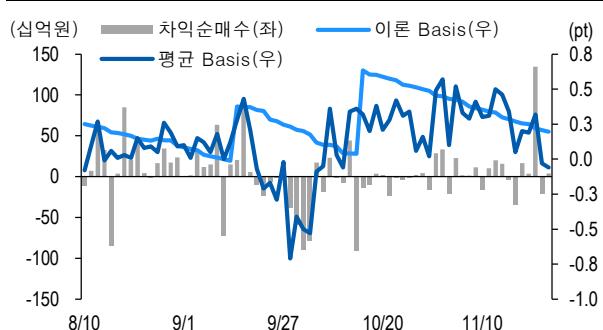
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.40	-0.26	-1.04	7,625.4	-
선물 12월물	395.40	-0.16	-0.65	22,659.0	281,333
선물 3월물	391.60	-0.15	-0.60	51.5	11,599
12월물(mini)	395.34	-0.18	-0.76	2,129.5	45,680
1월물(mini)	391.14	-0.19	-0.74	5.8	1,125



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.19	-0.06	0.00	-0.06%
베이시스(mini)	0.19	-0.06	-0.06	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.81	-3.90	-3.90	-0.28%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	0.04	0.04	-0.04%



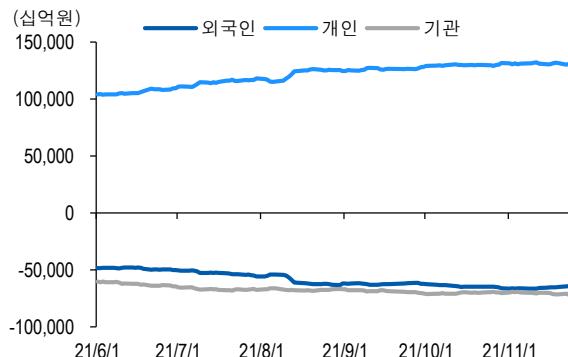
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	317.7	6.6	324.3	0.0	90.3	-332.0	-87.5	-1.5	2.1	25.4
개인	239.7	27.2	266.8	0.0	0.2	185.2	38.8	0.8	-0.3	31.1
기관	-593.2	-38.5	-631.7	3.9	-62.4	150.0	44.6	1.1	-2.0	-60.0
금융투자	-513.0	-114.7	-627.7	-7.6	2.1	368.4	44.8	0.3	-2.0	-19.8
투신	-70.8	6.9	-63.9	0.0	-20.1	-196.2	-0.2	0.1	0.0	-7.2
은행+보험+기타금융	3.8	85.6	89.5	0.0	1.3	-10.5	0.0	0.7	0.0	0.5
연기금+국가지자체	24.5	-9.2	15.3	11.4	-39.0	-11.7	0.0	0.0	0.0	-33.5
기타법인	35.8	4.8	40.6	0.0	0.4	-3.2	4.1	-0.4	0.3	3.5

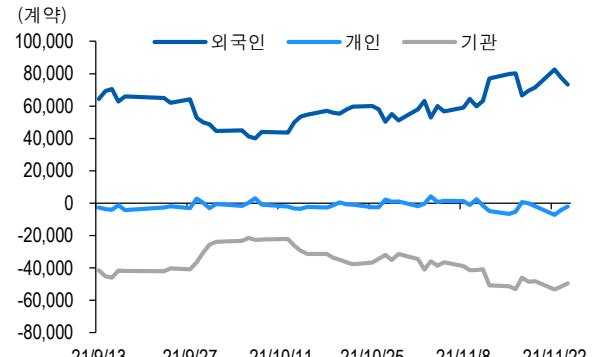
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	770,520	219.6	774,442	14.0%	지수옵션 전체	1,588,223	461.9	2,251,176							
Put	817,703	242.3	1,476,734	15.6%	PCR(금액기준)	1.10	VKOSPI	16.27%(-0.23%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	405.0(K+3)	1.40	-0.28	101,540	24,384	1,514	14.0	Put	400.0(K+1)	7.40	0.22	3,183	14,481	369	14.7
	402.5(K+2)	2.00	-0.41	69,021	17,481	312	14.0		397.5(K+0)	5.91	0.11	5,884	3,529	-18	14.8
	400.0(K+1)	2.81	-0.46	51,761	24,538	278	14.1		395.0(K-1)	4.66	0.01	12,995	6,643	678	15.0
	397.5(K+0)	3.85	-0.53	19,554	9,907	-702	14.3		392.5(K-2)	3.63	-0.06	23,129	4,876	333	15.3
	395.0(K-1)	5.06	-0.66	7,843	12,547	1,453	14.4		390.0(K-3)	2.80	-0.10	51,507	20,652	678	15.6

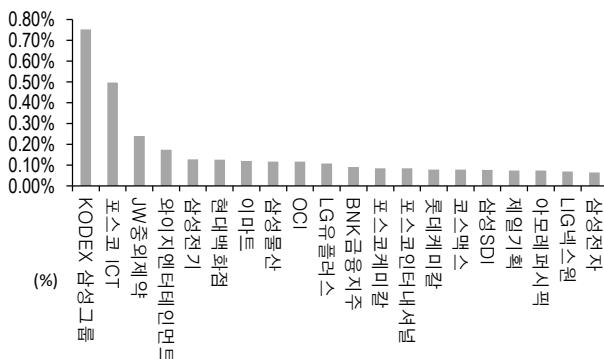
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,269,882	2,900.9	5,040,750	-2,519	19,009	28,413	-51,346	25.4	31.1	-60.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 이노텍	292,000	5.42	137.8	88.1	8,397	-1,808	-0.13%	-760	-1,977	2,737
엔씨소프트	710,000	0.42	119.4	77.8	10,112	603	0.02%	740	394	-1,134
삼성전자	74,800	-0.66	823.1	70.3	1,173,164	1,384	0.06%	6,256	37,456	-44,385
SK 하이닉스	119,500	0.42	327.3	68.5	112,893	-2,394	0.05%	-333	-1,085	28
LG 전자	129,000	1.18	81.9	64.9	30,172	265	-0.02%	3,922	1,041	-5,023
현대차	213,000	-0.93	83.7	60.5	44,690	1,993	0.05%	1,781	1,217	-2,996
POSCO	281,000	-1.75	55.9	60.2	15,327	-1,926	-0.10%	352	1,054	-1,406
LG 화학	746,000	0.67	79.9	55.0	8,773	111	-0.04%	100	-64	-36
셀트리온	211,500	0.24	73.0	52.7	33,875	-843	-0.14%	1,068	192	-1,260
기아	83,500	-0.24	52.8	51.0	52,639	-4,091	0.00%	-1,960	-1,811	3,775

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터