

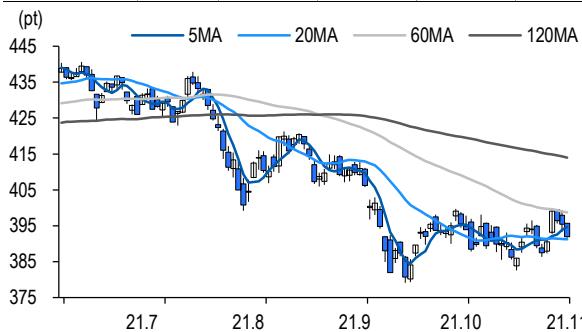


## 선물옵션시장 지표

2021.11.26

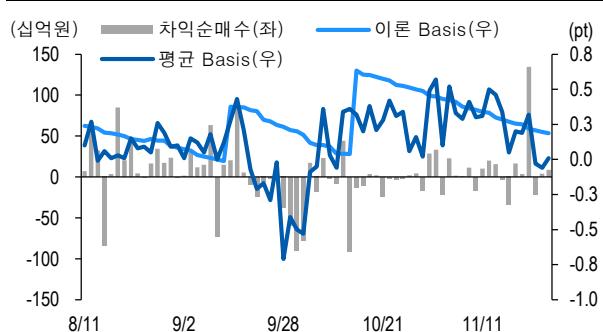
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	391.93	-0.88	-3.47	6,671.0	-
선물 12월물	392.60	-0.71	-2.80	18,369.0	284,039
선물 3월물	388.65	-0.75	-2.95	50.1	11,826
12월물(mini)	392.70	-0.68	-2.64	1,725.2	48,067
1월물(mini)	388.16	-0.76	-2.98	4.0	1,188



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.19	0.01	0.67	-0.05%
베이시스(mini)	0.19	0.01	0.77	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.80	-3.90	-3.90	-0.28%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	0.68	0.68	0.13%



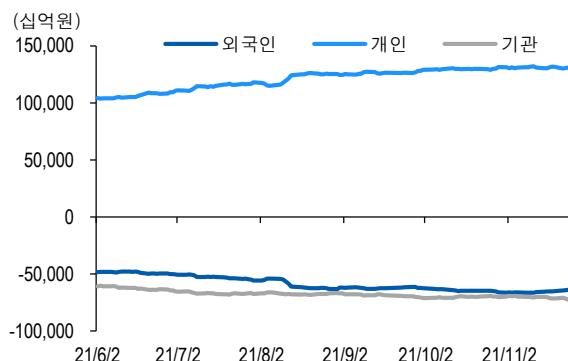
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-94.5	-51.2	-145.7	0.0	-93.3	-484.4	-32.7	-2.2	2.4	-19.5
개인	201.7	42.4	244.2	0.0	-0.1	357.4	21.4	2.0	-0.8	32.4
기관	-148.6	11.3	-137.4	8.7	-4.3	54.7	0.9	0.4	-1.7	-12.7
금융투자	-62.1	-83.3	-145.5	7.1	-1.2	70.4	0.9	0.5	-1.7	-1.8
투신	-14.9	-1.9	-16.8	0.0	-3.4	-6.8	0.0	-0.1	0.0	-1.4
은행+보험+기타금융	2.7	95.0	97.8	0.0	-2.4	-7.7	0.0	0.0	0.0	-0.3
연기금+국가지자체	-1.3	-1.5	-2.7	1.6	8.7	-1.2	0.0	0.0	0.0	-9.1
기타법인	41.4	-2.5	38.8	0.0	0.1	72.3	10.3	-0.2	0.1	-0.2

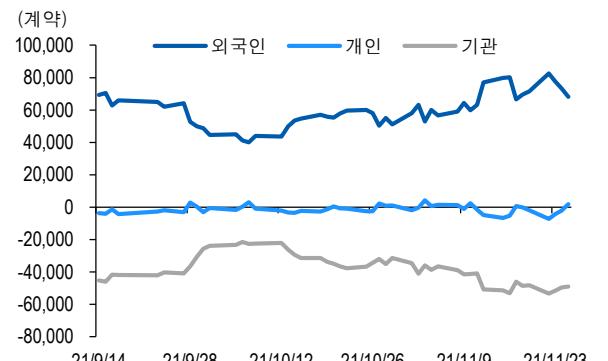
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	544,865	161.0	800,448	14.5%	지수옵션 전체	1,192,189	380.2	2,311,749							
Put	647,324	219.1	1,511,301	14.6%	PCR(금액기준)	1.36	VKOSPI	16.16%(-0.11%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	402.5(K+3)	1.18	-0.82	72,326	19,393	1,912	14.4	Put	397.5(K+1)	7.40	1.49	4,515	3,845	316	13.1
	400.0(K+2)	1.74	-1.07	77,309	26,543	2,005	14.5		395.0(K+0)	5.86	1.20	6,897	6,669	26	13.4
	397.5(K+1)	2.49	-1.36	41,644	10,635	728	14.7		392.5(K-1)	4.60	0.97	13,687	6,207	1,331	13.9
	395.0(K+0)	3.47	-1.59	16,229	11,806	-741	15.0		390.0(K-2)	3.55	0.75	38,490	20,945	293	14.3
	392.5(K-1)	4.68	-1.85	6,389	5,059	488	15.3		387.5(K-3)	2.69	0.53	52,964	12,908	1,627	14.7

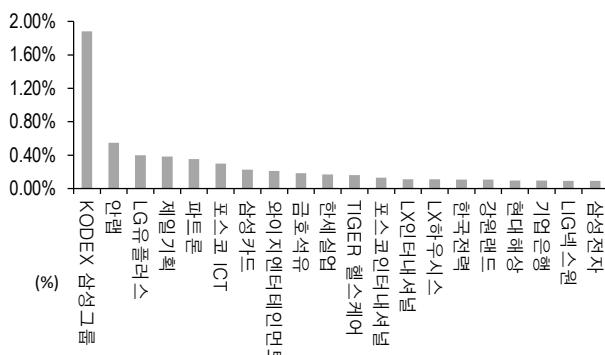
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,776,424	2,551.7	5,089,278	48,528	-25,389	47,255	-20,251	-19.5	32.4	-12.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	74,000	-1.07	839.3	90.8	1,212,466	39,302	0.09%	4,584	37,441	-42,018
엔씨소프트	700,000	-1.41	173.1	82.7	9,936	-176	-0.03%	-392	8	387
SK 하이닉스	117,500	-1.67	295.0	74.9	112,925	32	0.09%	-4,365	2,555	1,960
LG 이노텍	294,000	0.68	65.9	72.9	8,486	89	-0.09%	-910	422	488
현대차	210,500	-1.17	51.6	59.3	44,156	-534	0.03%	474	-1,165	677
삼성전기	178,500	0.00	41.1	54.0	38,734	2,604	0.05%	389	1,059	-1,658
LG 전자	125,500	-2.71	39.5	46.8	29,167	-1,005	0.01%	-2,910	1,432	1,451
포스코케미칼	164,000	6.84	114.1	45.4	24,166	2,521	0.08%	1,372	-727	-720
KT	31,050	0.32	5.0	44.5	58,985	-1,392	-0.14%	-897	-1,234	2,131
삼성 SDI	714,000	-2.33	60.4	41.9	28,803	624	0.05%	-170	671	-521

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터