

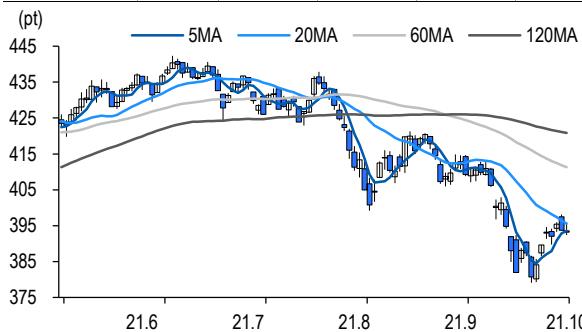


선물옵션시장 지표

2021.10.22

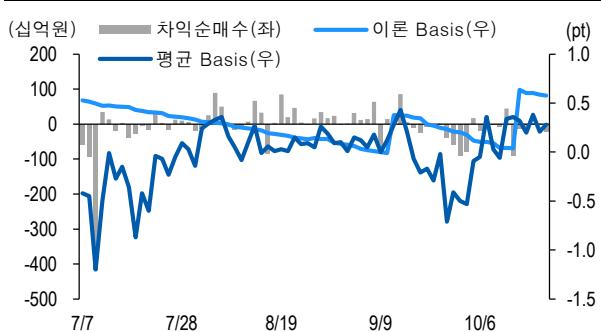
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.18	-0.14	-0.56	7,002.9	-
선물 12월물	393.40	-0.15	-0.60	22,566.8	269,313
선물 3월물	389.65	-0.10	-0.40	9.7	11,076
11월물(mini)	393.14	-0.14	-0.56	1,605.2	44,602
12월물(mini)	393.60	-0.10	-0.38	4.5	4,275



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.58	0.28	0.22	-0.08%
베이시스(mini)	0.25	0.04	-0.04	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.91	-3.84	-3.85	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.25	0.00	0.00	-0.06%



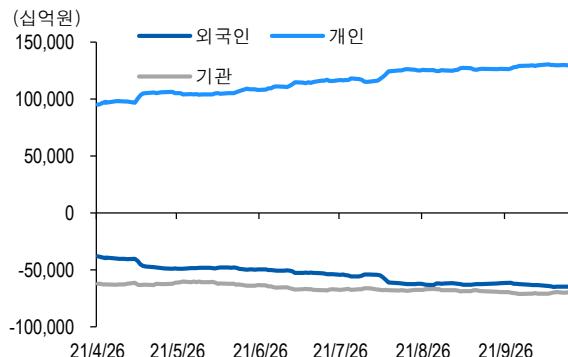
투자주체별 매매 동향

(십억원)

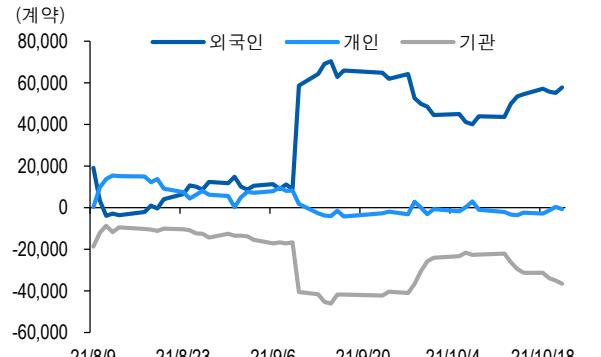
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	42.9	-53.3	-10.4	-19.5	138.6	276.4	-17.2	0.0	0.0	15.7
개인	-160.5	87.5	-73.0	0.0	-1.3	-110.1	1.2	0.0	0.6	-12.0
기관	127.9	-37.9	90.1	-3.8	24.8	-164.8	15.0	0.0	-0.4	-4.5
금융투자	188.8	-124.8	64.0	0.0	35.9	-98.7	15.1	0.2	-0.3	4.0
투신	-8.9	2.5	-6.4	0.0	0.3	-76.2	-0.1	-0.1	0.0	-6.0
은행+보험+기타금융	-16.3	82.3	66.0	0.0	-10.7	-4.6	0.0	0.0	-0.1	0.0
연기금+국가지자체	-41.5	-0.4	-41.9	-3.8	-2.2	14.7	0.0	0.0	0.0	-2.5
기타법인	-10.3	3.6	-6.7	0.0	-0.2	-1.5	1.0	0.0	-0.2	0.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

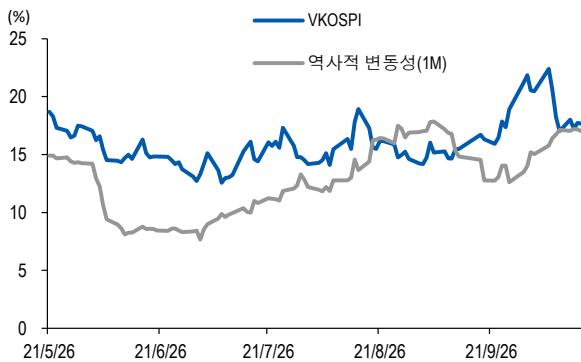
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	466,638	158.1	657,585	14.3%	지수옵션 전체		976,591	347.4	1,699,215		
Put	509,953	189.3	1,041,630	17.3%	PCR(금액기준)		1.20	VKOSPI	17.68%(-0.05%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	400.0(K+3)	2.88	-0.44	29,519	14,202	925	14.3	395.0(K+1)	6.86	0.01	5,167
	397.5(K+2)	3.87	-0.50	11,389	6,095	1,133	14.6	392.5(K+0)	5.72	-0.03	6,259
	395.0(K+1)	5.04	-0.55	7,933	7,849	802	15.0	390.0(K-1)	4.78	-0.01	10,850
	392.5(K+0)	6.40	-0.56	2,967	4,578	181	15.4	387.5(K-2)	3.97	-0.05	13,637
	390.0(K-1)	7.92	-0.70	1,971	5,559	-27	15.8	385.0(K-3)	3.32	-0.03	31,805
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	395.0(K+1)	6.86	0.01	5,167	5,013	372	15.7	392.5(K+0)	5.72	-0.03	6,259
	390.0(K-1)	4.78	-0.01	10,850	10,320	324	16.6	387.5(K-2)	3.97	-0.05	13,637
	387.5(K-3)	3.32	-0.03	31,805	10,513	973	17.6	385.0(K-4)	3.00	-0.04	31,805
	385.0(K-5)	2.75	-0.05	31,805	10,513	973	17.6	385.0(K-6)	2.50	-0.06	31,805
	385.0(K-7)	2.25	-0.07	31,805	10,513	973	17.6	385.0(K-8)	2.00	-0.08	31,805

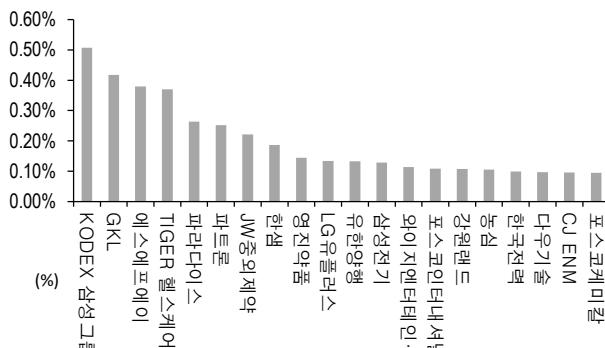
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
주식선물 전체	2,975,129	2,319.6	5,046,904	108,668	-1,274	38,220	-37,617	15.7	-12.0	-4.5				
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자	개인 순매수	기관 순매수	연기금등 순매수
기아	83,800	-0.24	90.9	79.5	50,535	658	0.01%	-1,170	1,785	-615	195	-810		
현대차	207,000	-0.96	123.3	76.6	49,168	1,951	0.03%	-691	2,456	-1,765	-1,075	-690		
삼성 SDI	724,000	-0.69	113.7	73.0	26,706	-3,681	-0.01%	1,173	-3,841	2,668	1,283	1,416		
NAVER	410,500	0.61	134.7	69.6	62,088	-789	0.01%	-652	169	390	-1,565	1,291		
삼성전자	70,300	-0.14	500.2	65.5	1,032,795	-7,318	-0.05%	-6,508	-5,985	12,493	6,530	5,950		
SK 이노베이션	257,000	-0.39	41.8	61.7	18,108	755	0.03%	26	-187	161	2,179	-1,980		
현대제철	45,850	1.78	13.9	59.5	18,957	2,830	0.00%	2,246	1,237	-3,483	562	-4,045		
LG 화학	806,000	-3.70	115.8	56.6	10,457	909	-0.10%	-53	293	-243	343	28		
현대모비스	267,000	-0.56	22.0	56.2	9,874	269	-0.13%	708	-637	-71	110	147		
카카오	128,000	-0.39	159.2	54.2	122,469	5,352	-0.07%	1,534	2,378	-4,391	1,250	-5,602		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터