

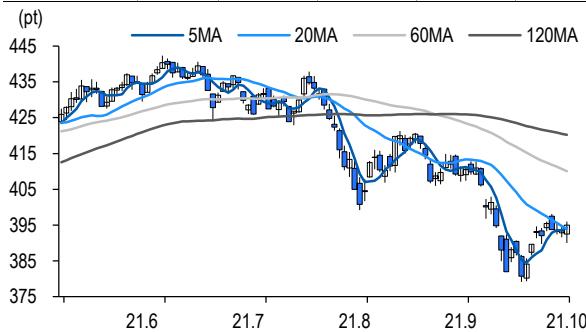


선물옵션시장 지표

2021.10.26

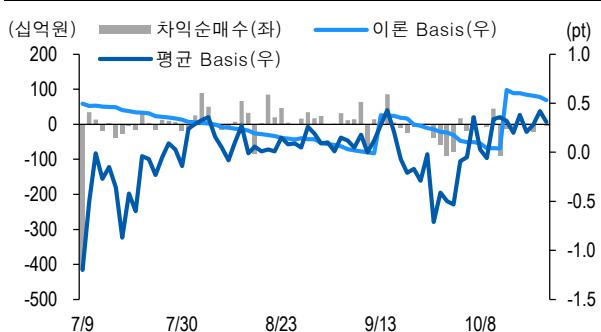
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.01	0.42	1.67	7,500.4	-
선물 12월물	395.85	0.37	1.45	19,908.5	272,587
선물 3월물	392.00	0.45	1.75	38.0	10,955
11월물(mini)	395.60	0.40	1.58	1,785.5	52,236
12월물(mini)	395.68	0.32	1.68	8.4	5,748



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.53	0.31	0.84	-0.06%
베이시스(mini)	0.20	0.04	0.59	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.90	-3.80	-3.80	-0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	0.20	0.60	0.60	0.10%



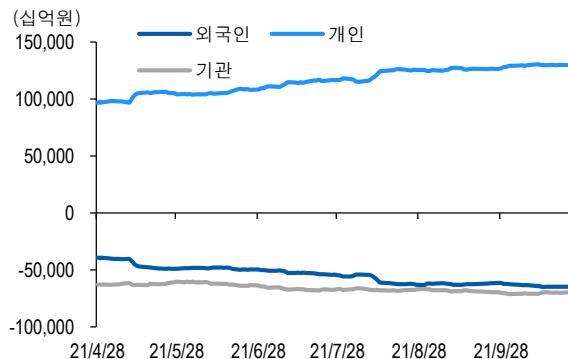
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	36.5	-44.4	-7.8	0.0	164.2	46.6	-17.1	-1.6	0.5	-0.8
개인	-304.7	36.3	-268.4	0.0	-0.2	-156.2	6.8	0.9	-1.8	20.5
기관	258.8	9.5	268.4	-3.3	-8.1	94.7	10.4	0.5	1.4	-22.3
금융투자	308.2	-1.9	306.3	-3.4	3.9	17.0	10.2	0.6	1.3	-4.5
투신	-1.9	-2.2	-4.1	0.0	4.5	82.9	0.2	0.0	0.0	0.0
은행+보험+기타금융	-22.6	16.7	-6.0	0.0	-5.2	12.5	0.0	-0.1	0.1	-1.0
연기금+국가지자체	-34.2	-1.8	-36.0	0.0	-10.2	-17.7	0.0	0.0	0.0	-16.9
기타법인	9.3	-1.5	7.9	0.0	-0.1	14.9	0.0	0.2	0.0	2.6

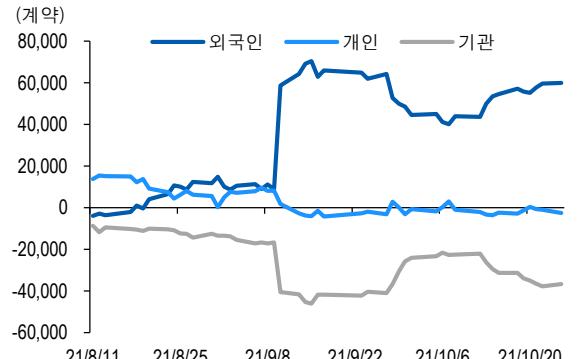
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

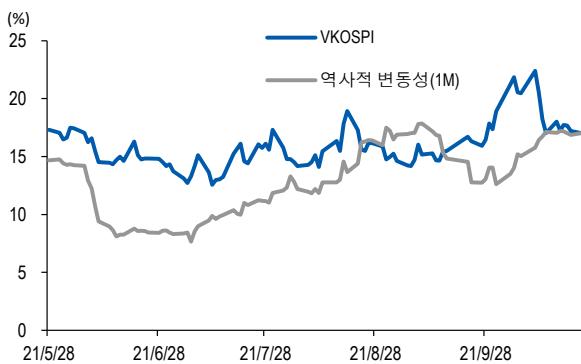


선물옵션시장 지표

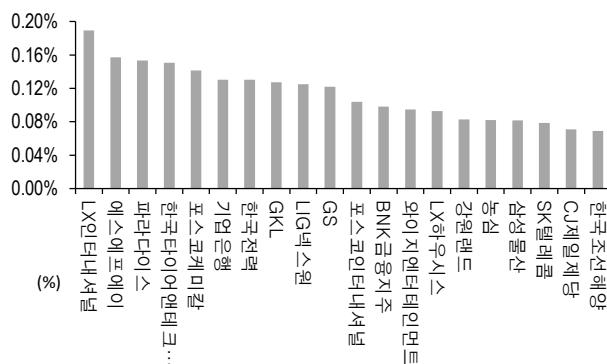
지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	571,629	181.4	687,108	14.5%	지수옵션 전체	1,194,520	363.9	1,795,793						
Put	622,891	182.5	1,108,685	16.3%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	17.03%(-0.17%p)						
<hr/>														
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	400.0(K+3)	3.07	0.22	55,058	17,830	2,345	14.5	Put						
	397.5(K+2)	4.19	0.31	23,509	8,187	1,497	15.0	395.0(K+1)	4.95	-1.09	5,789	6,592	1,467	14.5
	395.0(K+1)	5.55	0.43	13,811	8,972	841	15.5	392.5(K+0)	4.01	-0.99	7,082	4,685	189	15.1
	392.5(K+0)	7.12	0.57	5,930	5,154	86	16.2	390.0(K-1)	3.21	-0.90	17,483	16,705	4,726	15.6
	390.0(K-1)	8.83	0.67	2,497	5,817	208	16.8	387.5(K-2)	2.59	-0.79	15,674	5,477	734	16.2
<hr/>														
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터														

역시적 변동성과 VKOSPI



주식선물 평균베이시스 괴리율



주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,628,283	2,408.7	5,154,945	46,461	43,935	174	-46,531	-0.8	20.5	-22.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
GS 건설	41,650	0.85	10.0	100.2	49,494	-622	0.05%	2,213	-803	-1,410
현대제철	45,350	1.80	20.2	93.3	19,810	210	0.01%	2,946	3,355	-6,301
삼성전자	70,300	-0.42	524.6	75.8	1,062,938	2,676	0.03%	-10,814	15,125	-7,012
현대차	211,500	1.93	91.3	67.2	52,761	2,948	-0.02%	-664	2,553	-1,899
NAVER	403,000	-1.47	125.0	67.0	62,553	-69	0.01%	-133	281	-300
기아	84,500	0.96	56.1	65.0	56,767	5,514	0.01%	1,695	4,057	-5,662
다우기술	23,350	0.43	1.2	64.3	4,432	-746	-0.08%	58	70	-128
SK 이노베이션	257,500	0.39	48.3	61.3	17,727	204	0.01%	676	-25	-648
LG 화학	819,000	0.00	82.2	59.5	11,029	191	-0.03%	109	-34	-74
영진약품	4,840	0.21	0.7	58.9	7,349	751	-0.25%	1,546	2	-1,548