

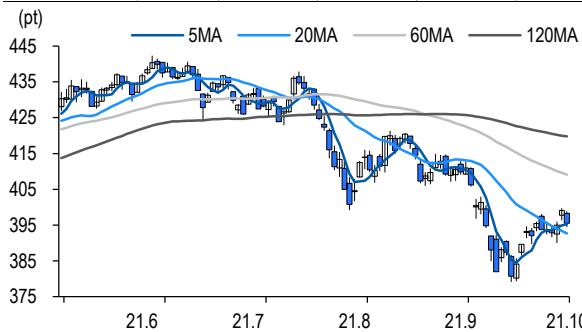


선물옵션시장 지표

2021.10.28

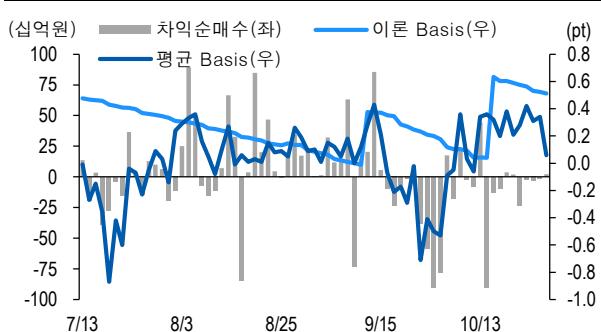
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.48	-0.90	-3.59	7,507.4	-
선물 12월물	395.45	-0.98	-3.90	20,268.5	270,136
선물 3월물	391.70	-0.94	-3.70	25.3	11,415
11월물(mini)	395.32	-0.95	-3.78	1,813.2	55,485
12월물(mini)	395.80	-0.89	-3.46	9.3	5,382



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.51	0.06	-0.03	-0.11%
베이시스(mini)	0.18	-0.10	-0.16	-0.07%
제1스프레드(SP)	-2.90	-3.87	-3.90	-0.25%
합성선물 베이시스(ATM)	0.18	-0.16	-0.16	-0.09%



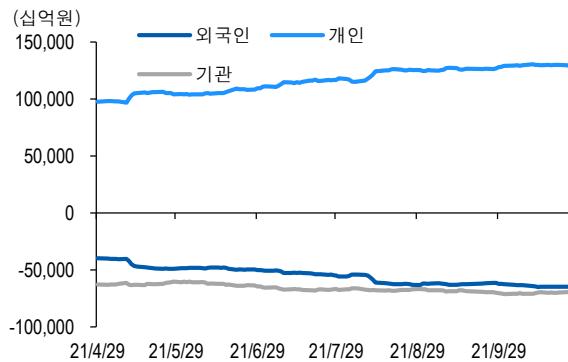
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-293.5	36.8	-256.7	0.0	-245.8	-785.6	33.3	-0.2	1.3	-27.3
개인	613.2	38.1	651.4	0.0	-2.5	369.7	99.8	-0.1	-1.2	10.5
기관	-349.3	-79.5	-428.8	2.0	-10.3	375.7	-138.5	0.7	0.1	13.2
금융투자	-184.3	-112.3	-296.6	0.1	-1.7	526.3	-138.5	0.7	0.1	11.5
투신	-34.1	18.9	-15.3	0.0	13.0	-188.6	0.0	0.0	0.0	-13.4
은행+보험+기타금융	-20.6	24.9	4.3	0.0	-5.5	32.3	0.0	-0.1	0.0	-1.0
연기금+국가지자체	-64.9	-4.2	-69.1	1.9	-17.2	5.7	0.0	0.0	0.0	16.0
기타법인	29.6	4.6	34.1	0.0	0.0	40.1	5.5	-0.4	-0.1	3.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



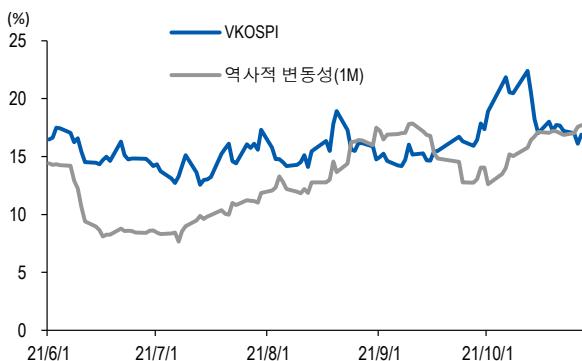
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	597,201	157.9	720,552	13.8%	지수옵션 전체	1,211,163	363.0	1,918,155							
Put	613,962	205.1	1,197,603	16.0%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	16.88% (+0.077%p)							
<hr/>															
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	407.5(K+3)	0.92	-0.64	66,088	19,213	2,321	13.7	Put	402.5(K+1)	8.94	2.33	2,443	1,578	691	14.3
	405.0(K+2)	1.38	-0.90	70,779	22,712	3,102	13.8		400.0(K+0)	7.53	2.26	3,504	5,451	559	15.3
	402.5(K+1)	2.05	-1.19	51,279	14,562	2,822	14.1		397.5(K-1)	6.08	1.95	5,696	2,982	222	15.4
	400.0(K+0)	2.85	-1.52	39,580	20,288	2,724	14.2		395.0(K-2)	4.82	1.57	16,436	8,296	273	15.6
	397.5(K-1)	3.86	-1.90	14,539	9,192	817	14.3		392.5(K-3)	3.86	1.34	22,320	7,065	22	16.1

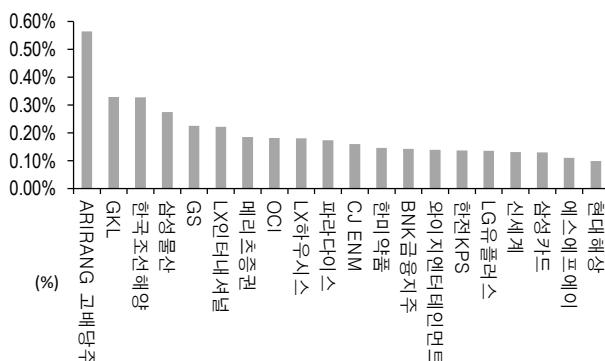
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 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)
주식선물 전체	2,982,169	2,065.2	5,442,859	102,428	-31,178	30,251	-4,568	-27.3	10.5	13.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	70,400	-1.12	488.2	69.0	1,163,238	5,856	0.01%	-22,562	25,770	-4,385	-9,873	6,549
현대제철	45,700	-1.30	11.2	61.9	17,471	-2,594	0.01%	-1,246	120	1,126	-915	2,041
NAVER	414,500	0.36	126.4	61.5	62,025	-982	-0.02%	-72	-444	516	-1,288	1,957
LG 화학	826,000	-0.48	70.0	58.2	11,089	264	-0.05%	-309	-72	381	119	597
삼성 SDI	750,000	0.27	71.2	57.6	29,689	-37	0.10%	624	90	-707	-458	-250
기아	85,200	0.35	76.5	56.8	51,588	-1,075	-0.01%	-367	-838	1,185	-998	2,183
현대차	213,500	-0.47	72.4	56.1	48,164	-2,438	-0.07%	2,344	-4,120	1,773	974	693
SK	252,500	-1.56	13.4	52.2	11,597	73	0.09%	-516	1,035	-519	-275	-314
SK 이노베이션	251,000	-2.33	28.1	52.2	17,745	954	0.08%	-111	112	-1	874	-886
GS 건설	41,150	-2.95	11.1	51.9	51,795	-247	0.00%	-1,800	1,847	-47	-1,063	1,001

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터