

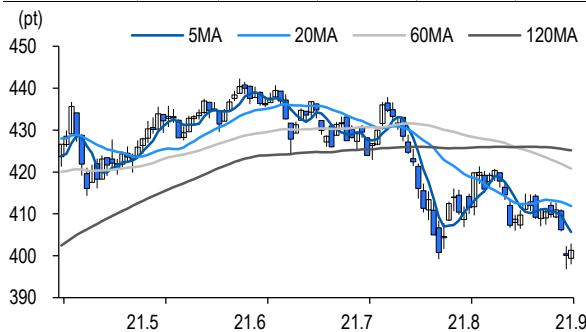


선물옵션시장 지표

2021.10.1

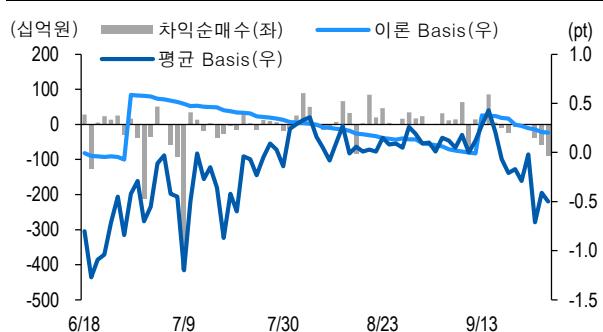
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	401.30	0.30	1.21	10,207.4	-
선물 12월물	401.50	0.59	2.35	31,207.4	272,664
선물 3월물	397.20	0.52	2.05	28.0	7,490
10월물(mini)	401.34	0.56	2.24	2,910.4	68,964
11월물(mini)	401.40	0.50	1.98	3.6	5,372



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.20	-0.50	0.20	-0.17%
베이시스(mini)	-0.44	-0.67	0.04	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.93	-3.88	-3.95	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.44	0.00	0.00	0.11%

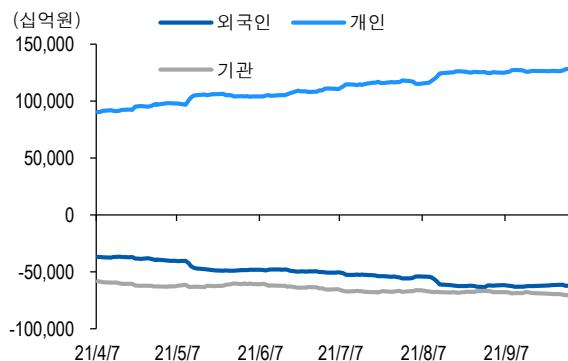


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	34.6	23.8	58.4	-0.9	-117.7	88.5	-219.8	1.6	0.6	-60.9
개인	167.9	15.2	183.1	0.0	-5.2	-236.3	-92.2	-1.1	-0.7	8.4
기관	-223.4	-38.6	-262.1	-89.2	-6.0	165.5	319.2	-0.5	0.4	53.3
금융투자	-226.0	-120.0	-345.9	-99.4	-38.2	-303.0	315.6	-0.5	-0.2	25.3
투신	28.1	4.2	32.3	0.0	20.6	474.9	3.5	0.0	0.6	10.2
은행+보험+기타금융	0.5	59.8	60.3	0.0	15.7	9.1	0.1	0.0	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-60.6	-0.7	-61.2	10.1	15.5	-15.5	0.0	0.0	0.0	17.4
기타법인	21.0	-0.4	20.6	0.0	2.2	-17.8	-7.2	0.0	-0.3	-0.7

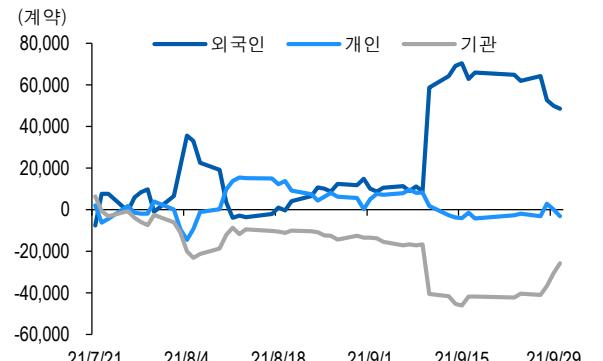
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



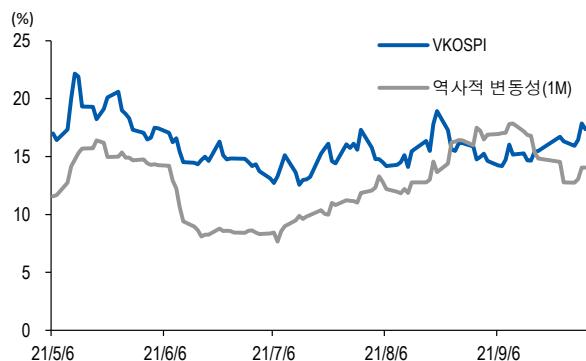
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	909,523	292.6	824,341	14.0%	지수옵션 전체	1,849,228	580.9
Put	939,705	288.3	1,144,153	17.0%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI 17.35%(-0.52%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	407.5(K+3)	2.15	0.27	78,505	14,697	3,344	13.9
	405.0(K+2)	3.10	0.40	80,591	10,820	2,395	14.3
	402.5(K+1)	4.27	0.59	40,591	5,567	1,365	14.7
	400.0(K+0)	5.67	0.76	22,861	4,891	488	15.1
	397.5(K-1)	7.27	0.94	5,510	2,156	-324	15.6
Put	402.5(K+1)	5.47	-1.62	3,333	6,562	-10	15.2
	400.0(K+0)	4.37	-1.46	18,078	22,954	-45	15.7
	397.5(K-1)	3.46	-1.31	15,452	12,150	-216	16.1
	395.0(K-2)	2.73	-1.14	38,736	16,525	471	16.6
	392.5(K-3)	2.14	-0.98	36,151	14,147	905	17.1

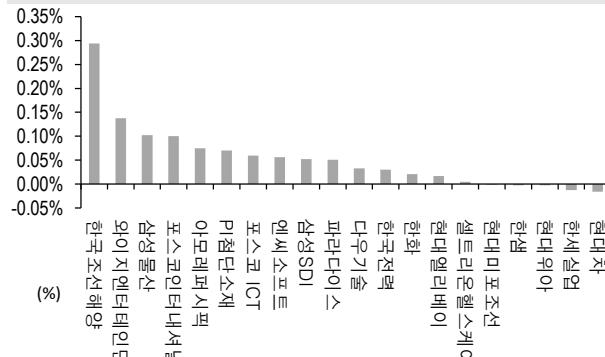
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,943,786	3,429.8	5,833,918	35,474	-45,857	17,442	27,765	-60.9	8.4	53.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
GS 건설	42,850	1.06	10.7	70.5	52,139	-656	-0.04%	-795	-112	902
삼성전자	74,300	0.13	943.1	69.8	1,120,191	17,424	-0.12%	-33,162	30,407	2,515
SK 하이닉스	103,500	3.50	271.1	68.3	128,983	-14,387	-0.15%	2,524	-14,213	11,744
삼성 SDI	718,000	1.41	110.3	61.0	41,393	94	0.05%	-502	140	362
LG 화학	778,000	1.04	155.4	59.8	13,538	-321	-0.12%	-233	-402	635
카카오	118,500	1.72	324.2	59.1	148,813	-15	-0.12%	2,057	588	-2,635
POSCO	331,000	0.30	52.5	56.8	24,197	66	-0.06%	543	185	-851
현대제철	47,350	0.42	13.4	56.1	18,820	-147	-0.07%	-518	566	-48
대한항공	33,650	0.30	47.0	54.5	222,923	-14,014	-0.06%	-9,992	3,437	6,320
KT	32,600	0.93	12.2	51.5	69,960	2,991	-0.07%	-3,267	3,087	182

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터