

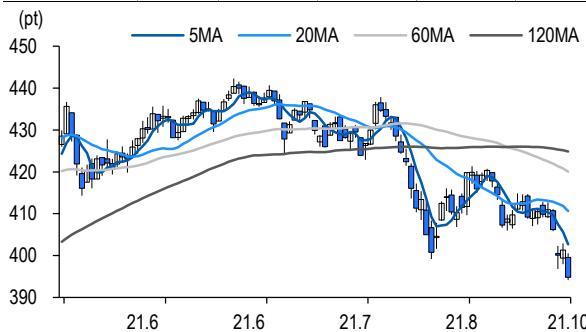


선물옵션시장 지표

2021.10.5

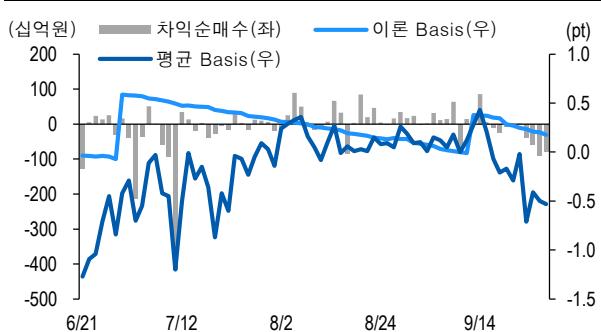
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.79	-1.62	-6.51	8,341.1	-
선물 12월물	393.60	-1.97	-7.90	32,647.5	277,902
선물 3월물	389.60	-1.91	-7.60	27.7	7,399
10월물(mini)	393.42	-1.97	-7.92	2,535.2	73,638
11월물(mini)	393.90	-1.87	-7.50	24.7	6,379



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.18	-0.53	-1.19	-0.18%
베이시스(mini)	-0.45	-0.67	-1.37	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.95	-3.95	-3.95	-0.25%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.45	-1.30	-1.30	-0.21%



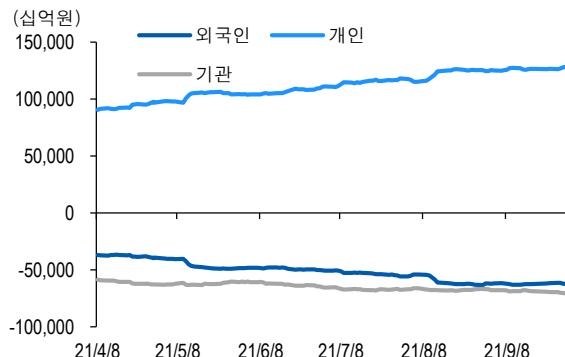
투자주체별 매매 동향

(십억원)

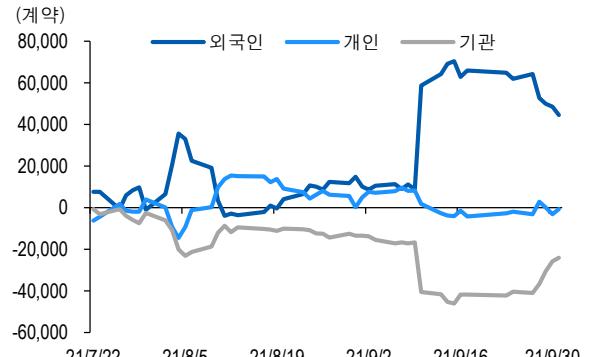
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-300.0	-45.9	-345.9	-0.2	-37.5	-316.3	-79.7	0.1	-2.4	-25.5
개인	761.1	113.7	874.8	0.0	-0.8	202.4	49.1	-1.9	11.3	-94.3
기관	-487.3	-56.7	-544.0	-77.8	-30.8	159.4	12.9	2.8	-8.4	120.0
금융투자	-361.0	-97.3	-458.4	-53.2	-34.0	425.4	12.9	3.4	-8.5	122.2
투신	-35.9	-15.7	-51.6	-6.7	-0.2	-301.7	0.0	-0.5	0.0	-23.8
은행+보험+기타금융	4.5	57.5	62.0	0.0	11.4	7.7	0.0	0.0	0.1	0.4
연기금+국가지자체	-27.7	-3.4	-31.2	-17.9	1.7	28.0	0.0	0.0	0.0	21.2
기타법인	26.2	-11.1	15.0	0.0	1.5	-45.5	17.7	-1.1	-0.4	-0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

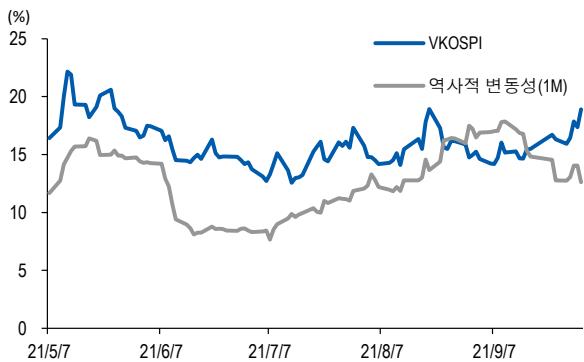
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	998,050	252.4	881,187	13.6%	지수옵션 전체	2,343,688	776.5	2,046,928
Put	1,345,638	524.1	1,165,741	19.5%	PCR(금액기준)	2.08	VKOSPI	18.91%(+1.56%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	410.0(K+3)	0.36	-1.05	126,194	31,503	9,267	13.3	405.0(K+1)
	407.5(K+2)	0.61	-1.54	108,388	22,179	7,482	13.5	402.5(K+0)
	405.0(K+1)	1.01	-2.09	107,757	17,049	6,229	13.7	400.0(K-1)
	402.5(K+0)	1.59	-2.68	74,292	9,704	4,137	14.0	397.5(K-2)
	400.0(K-1)	2.39	-3.28	60,036	9,023	4,132	14.4	395.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	405.0(K+1)	12.40	5.60	1,399	7,994	-15	19.5	402.5(K+0)
	402.5(K+0)	10.60	5.13	3,909	6,456	-106	19.6	400.0(K-1)
	400.0(K-1)	8.88	4.51	12,553	22,999	45	19.4	397.5(K-2)
	397.5(K-2)	7.30	3.84	8,198	11,755	-395	19.2	395.0(K-3)
	395.0(K-3)	6.00	3.27	31,239	16,433	-92	19.4	

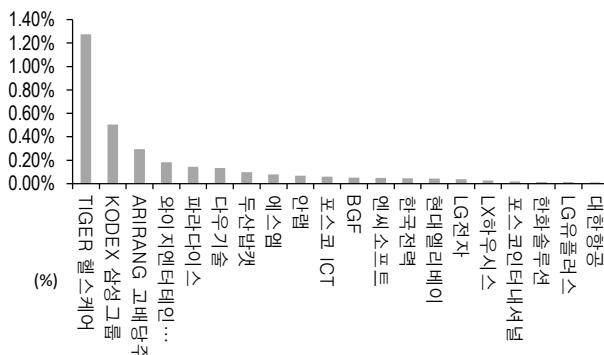
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,439,020	2,778.1	5,849,670	15,752	-27,663	-86,666	113,999	-25.5	-94.3	120.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성 SDI	706,000	-1.67	112.0	85.9	39,853	-1,540	-0.02%	210	-1,501	1,313
삼성전자	73,200	-1.48	748.0	64.9	1,081,578	-38,613	-0.16%	-13,686	-46,722	60,318
GS 건설	41,400	-3.38	11.2	63.1	50,469	-1,670	-0.02%	2,049	-4,328	2,282
SK 하이닉스	100,500	-2.90	167.1	62.2	137,017	8,034	-0.08%	-8,071	6,131	1,890
롯데케미칼	241,000	-0.21	23.1	60.6	7,057	-374	-0.22%	395	-531	138
하나금융지주	45,750	-0.87	25.2	59.5	123,854	1,972	-0.30%	-7,589	2,769	4,751
LG 화학	767,000	-1.41	105.0	58.9	12,912	-626	-0.15%	269	-550	281
카카오	116,000	-2.11	151.0	55.5	148,460	-353	-0.04%	140	-3,384	3,121
NAVER	382,000	-1.80	82.6	54.7	63,068	1,535	-0.04%	-482	53	429
SK 이노베이션	263,500	-0.94	54.5	51.3	21,364	443	-0.02%	1,085	-552	-513

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터