

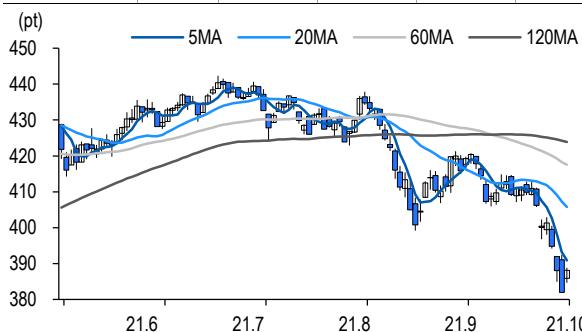


## 선물옵션시장 지표

2021.10.8

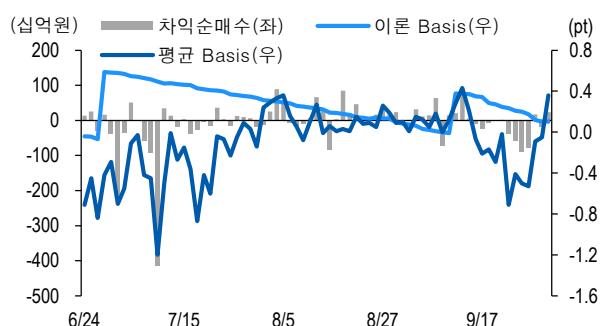
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	388.14	1.63	6.21	8,882.2	-
선물 12월물	388.20	1.52	5.80	37,025.1	274,954
선물 3월물	384.15	1.57	5.95	51.8	9,360
10월물(mini)	387.94	1.54	5.90	2,738.7	96,232
11월물(mini)	388.10	1.51	5.76	16.0	6,189



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.10	0.36	0.06	0.07%
베이시스(mini)	-0.52	-0.03	-0.20	0.13%
제1스프레드(SP)	-2.97	-4.02	-4.05	-0.27%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.52	-0.15	-0.15	0.10%



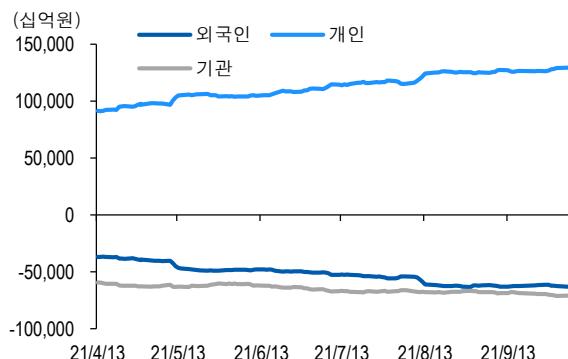
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-106.1	25.7	-80.3	0.0	240.7	-64.5	-44.6	-4.4	14.3	99.3
개인	-532.6	-9.6	-542.2	0.0	2.3	276.9	-23.9	1.4	-11.0	-6.7
기관	614.3	-5.0	609.3	23.3	-64.1	-179.7	76.9	3.1	-3.3	-96.4
금융투자	582.3	-135.6	446.7	11.9	16.2	-646.0	76.8	3.1	-2.4	-105.2
투신	61.5	29.6	91.1	1.9	31.9	481.7	0.1	0.0	0.1	59.4
은행+보험+기타금융	-6.2	117.5	111.3	0.0	-4.1	-6.7	0.1	0.0	-0.9	0.0
연기금+국가지자체	-19.9	-9.5	-29.4	7.5	-116.9	-8.6	0.0	0.0	0.0	-50.6
기타법인	24.4	-11.1	13.2	0.0	0.6	-32.7	-8.5	-0.1	-0.1	3.8

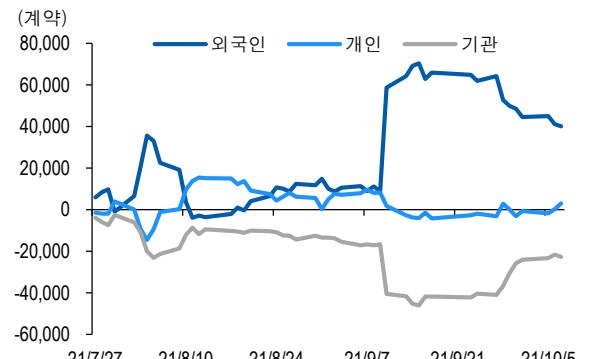
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이

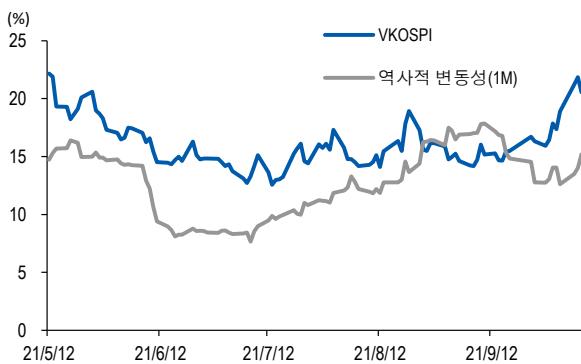


## 선물옵션시장 지표

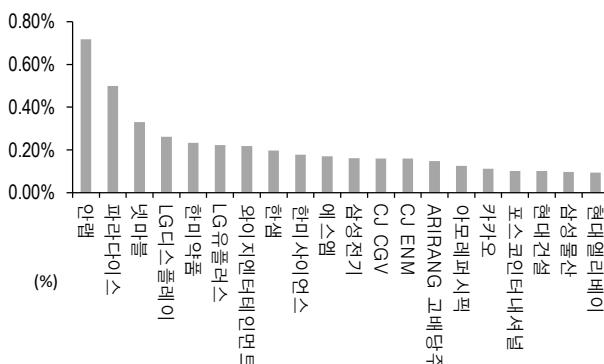
### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,358,577	415.1	1,058,596	17.2%	지수옵션 전체	2,681,935	817.0	2,353,360
Put	1,323,358	401.9	1,294,764	21.2%	PCR(금액기준)	0.97	VKOSPI	20.54%(-1.30%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	390.0(K+3)	3.16	1.40	142,312	12,130	3,905	17.3	Put
	387.5(K+2)	4.47	1.91	49,494	6,787	1,920	17.9	385.0(K+1)
	385.0(K+1)	6.03	2.43	15,308	5,430	1,694	18.5	382.5(K+0)
	382.5(K+0)	7.80	2.96	3,713	2,115	1,295	19.1	380.0(K-1)
	380.0(K-1)	9.71	3.42	1,288	1,358	688	19.6	377.5(K-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	4,326,866	3,585.0	5,807,771	-8,089	195,400	-62,746	-137,869	99.3	-6.7	-96.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
GS건설	41,850	3.72	23.6	118.3	40,883	-7,160	-0.02%	1,651	-3,225	1,574
현대건설	50,700	3.79	17.6	91.9	15,233	-1,065	0.10%	2,494	-997	-1,633
한국조선해양	97,000	2.54	18.8	89.8	16,102	-1,690	0.00%	32	1,223	-1,585
LG화학	734,000	-1.61	139.1	75.8	12,631	-212	-0.06%	1,815	-948	-867
삼성전기	165,500	3.44	53.2	73.7	20,040	-4,184	0.16%	469	8,128	-8,594
삼성SDI	668,000	-0.30	112.4	69.8	31,403	-959	-0.05%	431	333	-802
현대제철	44,650	3.12	20.1	69.5	20,232	1,058	0.03%	2,552	-2,001	-584
하나금융지주	45,400	1.34	18.5	69.4	102,252	-13,835	-0.01%	1,151	-967	-184
삼성생명	72,800	0.00	10.1	69.1	16,969	-560	0.01%	-2,444	392	2,008
삼성전자	71,700	0.70	655.6	67.6	979,079	-26,927	-0.01%	25,957	-4,951	-20,972
<hr/>										