

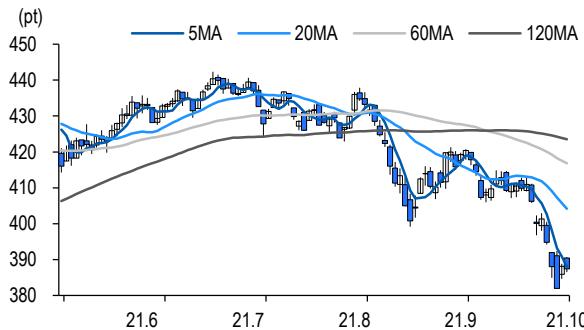


## 선물옵션시장 지표

2021.10.12

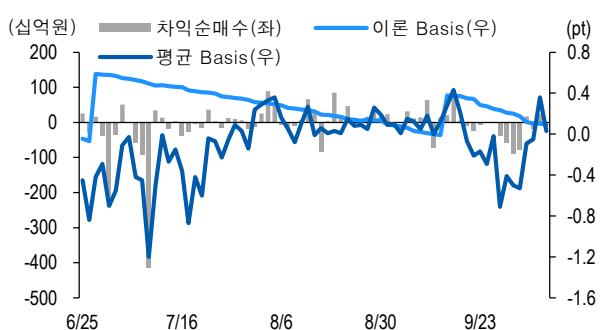
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	387.42	-0.19	-0.72	8,824.5	-
선물 12월물	388.05	-0.04	-0.15	34,928.1	272,997
선물 3월물	384.05	-0.03	-0.10	22.0	9,285
10월물(mini)	387.74	-0.05	-0.20	2,082.8	96,959
11월물(mini)	387.78	-0.08	-0.32	16.3	6,295



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.09	0.03	0.63	-0.02%
베이시스(mini)	-0.53	-0.22	0.32	0.08%
제1스프레드(SP)	-2.96	-3.99	-3.95	-0.27%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.53	0.36	0.36	0.23%



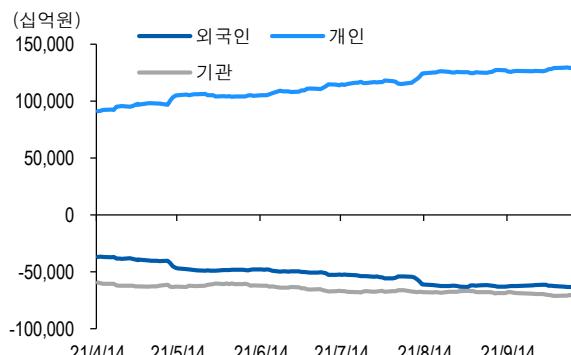
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

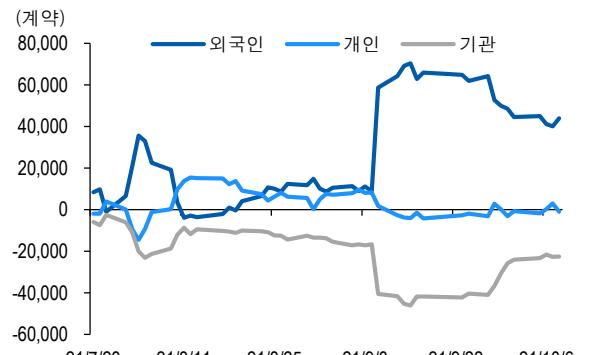
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-47.2	3.6	-43.6	0.0	-129.7	283.0	102.4	1.8	-13.1	-40.9
개인	462.7	9.3	472.0	0.0	-2.0	-366.3	-16.4	-0.5	14.6	-35.2
기관	-452.7	-13.3	-466.0	-1.9	-52.2	97.0	-83.4	-1.0	-1.1	79.1
금융투자	-356.4	-6.0	-362.4	-3.7	-1.1	255.3	-83.3	-0.9	-1.0	36.6
투신	38.8	31.0	69.8	0.0	13.0	-166.1	0.0	0.0	-0.1	-15.9
은행+보험+기타금융	-14.2	-33.0	-47.2	0.0	-18.1	1.1	-0.1	0.0	0.0	-1.2
연기금+국가지자체	-87.3	-3.1	-90.4	1.8	-49.9	6.7	0.0	0.0	0.0	59.6
기타법인	37.3	0.4	37.6	0.0	-1.0	-13.7	-2.6	-0.3	-0.3	-3.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

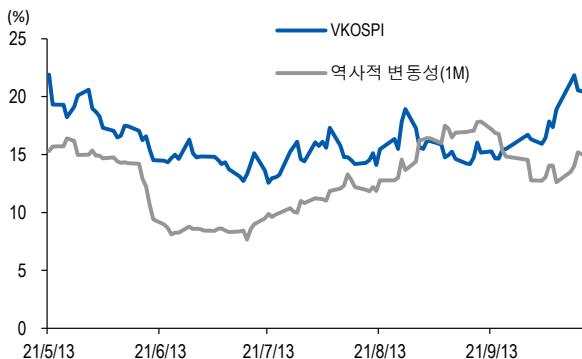
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	1,585,667	358.3	1,097,794	15.7%	지수옵션 전체		3,399,063	815.7	2,453,588
Put	1,813,396	457.5	1,355,794	18.6%	PCR(금액기준)		1.28	VKOSPI	20.47%(-0.07%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	395.0(K+3)	0.83	-0.47	269,939	21,747	1,009	15.3	390.0(K+1)	4.77
	392.5(K+2)	1.54	-0.57	170,909	19,753	5,625	16.2	387.5(K+0)	3.57
	390.0(K+1)	2.50	-0.66	96,998	13,973	1,843	16.8	385.0(K-1)	2.62
	387.5(K+0)	3.85	-0.62	27,262	7,585	798	18.0	382.5(K-2)	1.93
	385.0(K-1)	5.42	-0.61	8,846	5,497	67	19.0	380.0(K-3)	1.39

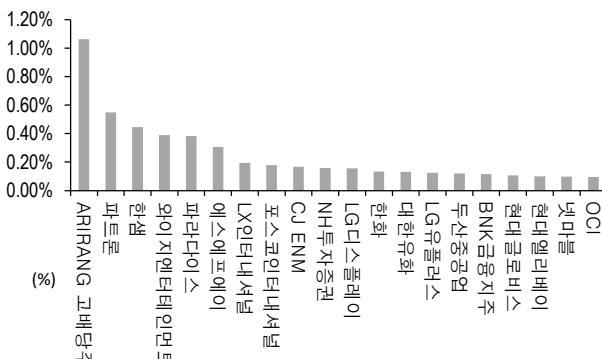
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,695,255	3,402.3	5,829,750	21,979	-88,697	-42,549	130,810	-40.9	-35.2	79.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	249,500	-0.99	74.8	85.8	16,560	-3,108	0.02%	-1,502	-45	1,474	-290	1,764
삼성 SDI	686,000	2.69	159.2	76.4	29,920	-1,483	0.01%	974	-617	43	25	-128
현대제철	45,600	2.13	21.6	67.0	19,269	-963	-0.02%	-1,272	1,009	283	-207	490
카카오	116,500	-2.51	309.1	66.6	141,836	-4,117	-0.17%	-3,714	-132	3,846	7,804	1,044
삼성전자	71,800	0.14	664.5	66.0	916,456	-62,623	-0.11%	-29,032	244	28,788	-15,093	44,254
LG 디스플레이	17,950	0.28	21.9	64.8	320,481	-12,940	0.16%	-16,790	-5,471	22,271	-1,742	4,147
한국금융지주	84,000	-1.18	7.8	60.5	26,220	-1,638	-0.17%	-919	-373	1,292	852	440
LG 전자	120,000	-3.23	101.4	59.8	66,197	9,693	-0.23%	-1,316	-6,662	8,007	13,308	1,723
NAVER	387,500	-1.65	124.6	59.6	37,874	-14,841	-0.03%	-1,289	-945	2,163	1,224	671
LG 화학	760,000	3.54	129.0	55.7	14,177	1,546	-0.22%	520	-1,041	522	1,370	695

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터