

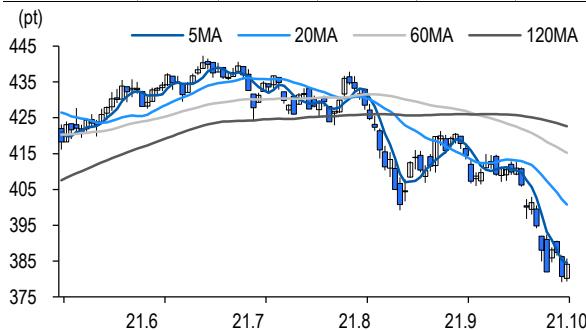


선물옵션시장 지표

2021.10.14

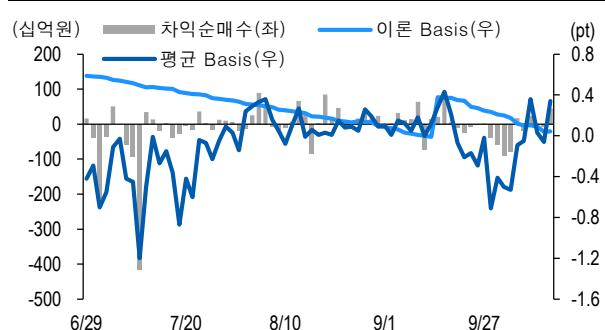
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	384.10	0.90	3.41	8,380.2	-
선물 12월물	384.60	1.14	4.35	26,566.4	279,523
선물 3월물	380.80	1.13	4.25	30.5	10,698
10월물(mini)	384.34	1.13	4.30	2,063.8	113,819
11월물(mini)	384.56	1.30	4.94	64.5	19,843



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.04	0.34	0.50	0.08%
베이시스(mini)	-0.59	0.00	0.24	0.15%
제1스프레드(SP)	-2.97	-3.75	-3.75	-0.20%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.59	0.18	0.18	0.20%



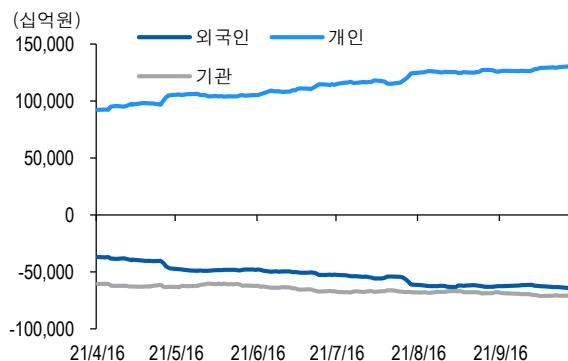
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-273.0	39.2	-233.8	3.2	-65.6	582.1	15.0	3.2	3.4	42.4
개인	-531.3	22.2	-509.0	0.0	-4.1	-74.2	-39.1	-0.5	-1.0	-103.8
기관	772.4	-62.4	710.0	41.1	118.0	-432.6	29.5	-0.4	-0.6	60.9
금융투자	588.3	-37.5	550.9	14.5	30.9	-752.6	29.3	2.0	0.0	82.7
투신	82.5	20.5	103.0	9.6	48.8	248.2	0.0	-1.2	-0.1	14.3
은행+보험+기타금융	-4.1	-39.0	-43.2	0.0	-0.9	80.1	0.1	-1.2	-0.5	0.0
연기금+국가지자체	78.6	0.3	78.9	7.5	-2.3	-8.2	0.0	0.0	0.0	-36.1
기타법인	31.9	0.9	32.8	0.0	0.3	-75.3	-5.3	-2.2	-1.8	0.5

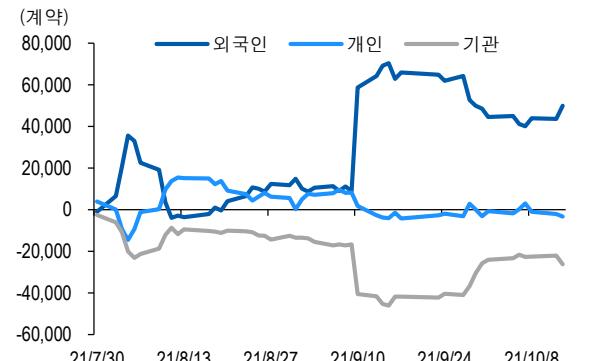
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

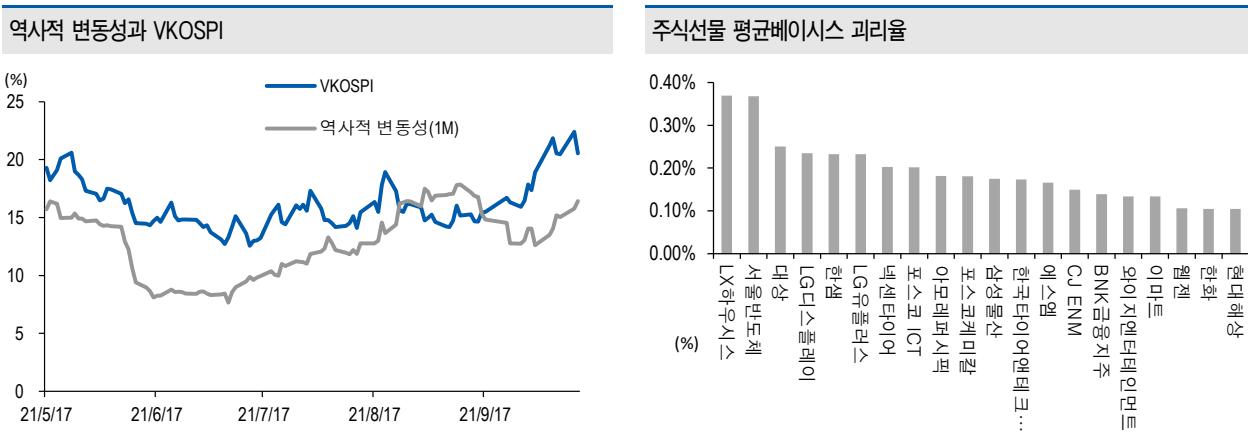
투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	1,975,724	392.9	1,242,303	15.9%	지수옵션 전체		4,110,225	731.9	2,718,984
Put	2,134,501	339.1	1,476,681	19.2%	PCR(금액기준)		0.86	VKOSPI	20.54%(-1.86%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	387.5(K+3)	0.58	0.17	472,608	22,861	2,049	15.6	382.5(K+1)	1.22
	385.0(K+2)	1.50	0.54	273,681	17,089	1,752	16.8	380.0(K+0)	0.57
	382.5(K+1)	2.99	1.19	97,485	8,136	593	18.4	377.5(K-1)	0.28
	380.0(K+0)	4.85	1.85	30,542	5,694	-1,359	19.5	375.0(K-2)	0.12
	377.5(K-1)	7.05	2.45	3,917	1,111	-170	21.6	372.5(K-3)	0.06
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	382.5(K+1)	1.22	-2.93	164,224	19,668	6,038	17.0	380.0(K+0)	0.57
	380.0(K+0)	0.57	-2.28	281,628	37,004	10,689	17.6	377.5(K-1)	0.28
	377.5(K-1)	0.28	-1.63	335,676	24,907	6,273	19.0	375.0(K-2)	0.12
	375.0(K-2)	0.12	-1.21	294,555	43,373	1,907	19.9	372.5(K-3)	0.06
	372.5(K-3)	0.06	-0.74	224,599	41,022	2,843	21.4		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,978,327	3,940.0	5,948,180	50,932	63,493	-85,844	21,968	42.4	-103.8	60.9	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
GS건설	41,650	1.83	12.4	86.4	25,396	-8,797	0.04%	283	-1,067	784	1,107
SK 이노베이션	259,000	0.78	54.4	68.3	13,564	-1,801	-0.07%	-2,108	-186	2,284	402
카카오	117,500	3.07	211.6	67.0	111,048	-31,728	0.09%	793	-3,589	2,764	781
하나금융지주	44,150	-0.11	21.1	66.7	47,682	-27,381	-0.03%	702	-994	348	-841
NAVER	380,000	2.15	143.9	65.8	29,735	-6,686	-0.29%	2,706	-16,179	13,548	13,375
삼성전자	69,200	0.14	950.5	57.4	603,254	-188,940	-0.03%	21,827	7,252	-28,126	21,520
현대제철	47,300	3.73	24.0	55.3	15,495	-3,584	0.00%	-819	-3,807	4,626	3,891
LG전자	122,000	-1.21	62.5	55.1	49,782	-6,677	0.08%	-4,568	-2,251	6,613	1,097
SK하이닉스	92,100	0.77	142.7	51.3	73,800	-21,287	-0.04%	-2,477	-3,088	5,589	8,787
삼성SDI	675,000	1.50	67.7	48.5	9,948	-8,931	0.07%	3	-383	384	119

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터