

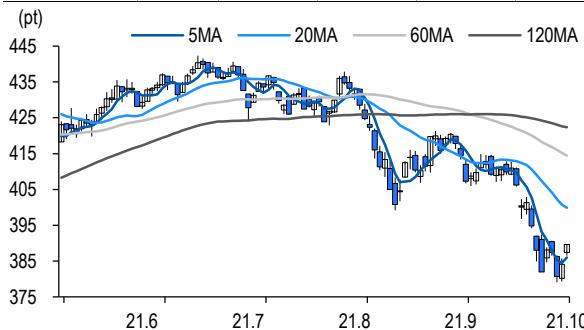


## 선물옵션시장 지표

2021.10.15

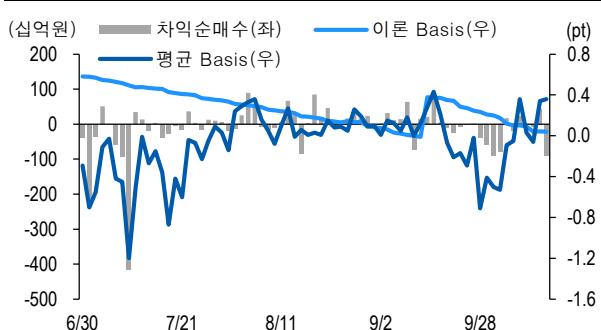
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.59	1.43	5.49	8,899.1	-
선물 12월물	389.40	1.25	4.80	29,523.0	274,387
선물 3월물	385.25	1.17	4.45	25.0	10,723
10월물(mini)	389.00	1.21	4.66	1,599.5	0
11월물(mini)	389.40	1.26	4.84	923.4	26,056



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.04	0.36	-0.19	0.08%
베이시스(mini)	-0.60	-0.02	-0.59	0.15%
제1스프레드(SP)	-2.94	-3.75	-3.75	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.60	-0.64	-0.64	-0.01%



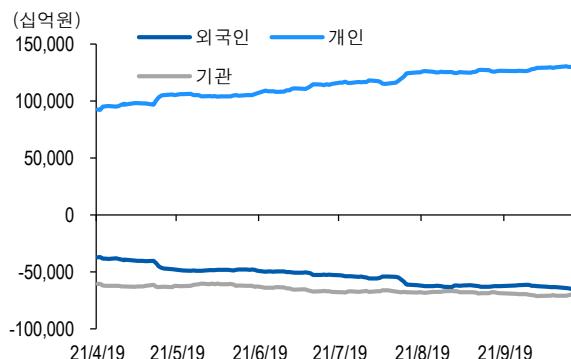
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-394.2	26.1	-368.1	-134.8	-134.1	109.8	243.0	2.1	8.3	-12.0
개인	-125.8	-30.1	-156.0	0.0	-18.0	88.8	-120.8	2.1	-4.4	8.8
기관	502.9	0.9	503.7	44.1	80.8	-188.3	-122.4	-3.6	-1.7	12.4
금융투자	461.5	31.9	493.4	44.1	52.9	-103.6	-109.6	-1.1	0.5	29.6
투신	90.0	28.3	118.3	0.1	24.5	12.7	0.4	-1.1	0.0	31.4
은행+보험+기타금융	-6.5	-64.0	-70.5	0.0	-6.4	-99.9	-13.2	-1.3	-2.2	0.0
연기금+국가지자체	3.9	-0.8	3.1	-0.1	11.7	2.5	-0.1	0.0	0.0	-48.6
기타법인	17.1	3.2	20.3	0.0	-0.6	-10.3	0.2	-0.6	-2.2	-9.3

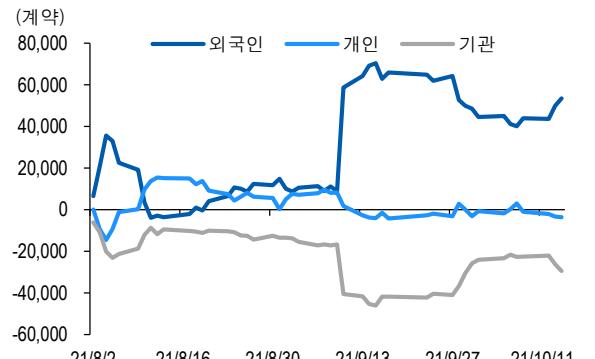
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



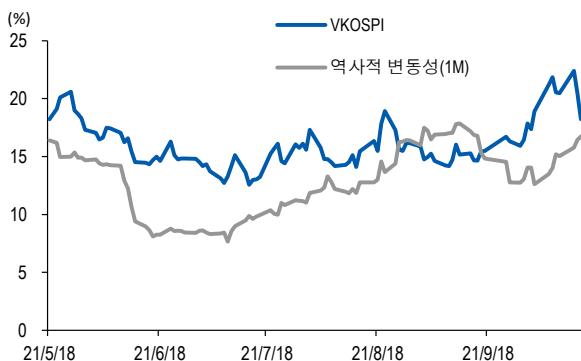
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,017,988	350.7	524,414	6.0%	지수옵션 전체	4,274,226	647.1	1,371,348
Put	2,256,238	296.4	846,934	12.1%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	18.21%(-2.33%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	392.5(K+3)	0.01	-0.03	375,215	0	-35,506	6.9	387.5(K+1)
	390.0(K+2)	0.09	-0.08	819,294	0	-36,778	2.9	385.0(K+0)
	387.5(K+1)	1.51	0.93	398,156	0	-22,861	7.7	382.5(K-1)
	385.0(K+0)	3.96	2.46	96,787	0	-17,089	14.1	380.0(K-2)
	382.5(K-1)	6.40	3.41	13,896	0	-8,136	18.0	377.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	387.5(K+1)	0.04	-3.75	577,017	0	-11,747	6.8	385.0(K+0)
	385.0(K+0)	0.01	-2.20	593,239	0	-22,313	10.3	382.5(K-1)
	382.5(K-1)	0.01	-1.21	350,476	0	-19,668	15.0	380.0(K-2)
	380.0(K-2)	0.01	-0.56	157,188	0	-37,004	19.7	377.5(K-3)
	377.5(K-3)	0.01	-0.27	89,927	0	-24,907	24.2	

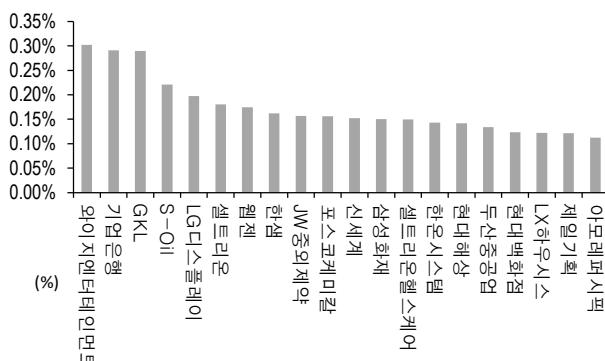
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	5,608,421	4,151.0	4,456,721	-1,491,459	-19,014	32,741	-226	-12.0	8.8	12.4
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
SK	266,000	0.76	22.1	58.2	0	-8,563	-0.11%	-462	837	-164
아모레퍼시픽	182,500	3.99	25.4	49.6	0	-11,976	0.11%	685	101	-786
BNK 금융지주	8,600	-0.58	5.9	49.0	0	-58,882	-0.01%	-9,103	4,134	4,968
호텔신라	92,600	0.22	16.5	45.4	0	-16,911	0.09%	-2,005	1,032	997
아모레 G	49,650	3.12	3.3	41.8	0	-8,562	-0.02%	-659	-89	748
GS 건설	42,000	0.84	10.2	39.7	0	-25,396	-0.03%	-3,798	3,864	-132
삼성전자	69,100	-0.14	520.4	38.8	0	-603,254	-0.06%	8,321	-38,602	43,258
LG 전자	124,000	1.64	45.1	38.7	0	-49,782	0.04%	-2,701	-1,799	4,477
SK 하이닉스	93,400	1.41	80.9	37.8	0	-73,800	-0.03%	-1,709	-7,646	9,384
한샘	107,000	0.94	7.6	37.2	0	-9,289	0.16%	-891	3,194	-2,309

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터