

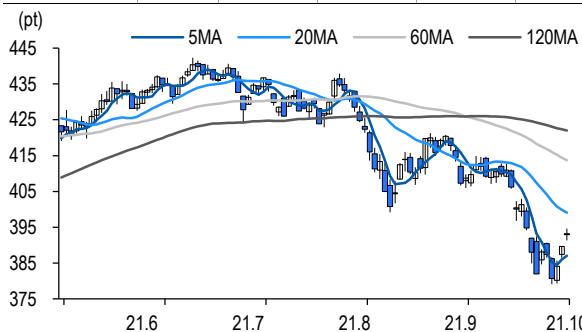


## 선물옵션시장 지표

2021.10.18

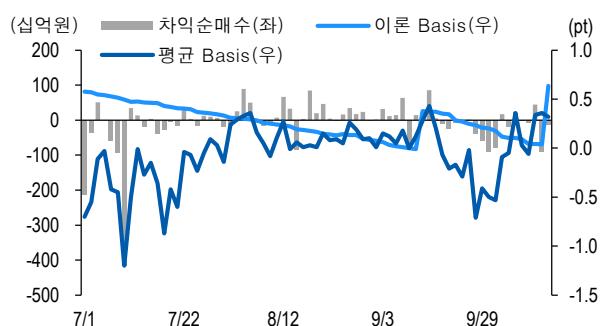
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.19	0.92	3.60	8,295.5	-
선물 12월물	394.60	1.34	5.20	23,373.6	273,899
선물 3월물	390.50	1.36	5.25	52.4	11,030
10월물(mini)	394.26	1.25	4.86	1,754.9	31,831
11월물(mini)	393.60	1.08	3.96	10.0	4,137



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.63	0.32	1.41	-0.08%
베이시스(mini)	0.31	0.05	1.07	-0.07%
제1스프레드(SP)	-2.93	-3.94	-3.95	-0.26%
합성선물 베이시스(ATM)	0.31	1.03	1.03	0.18%



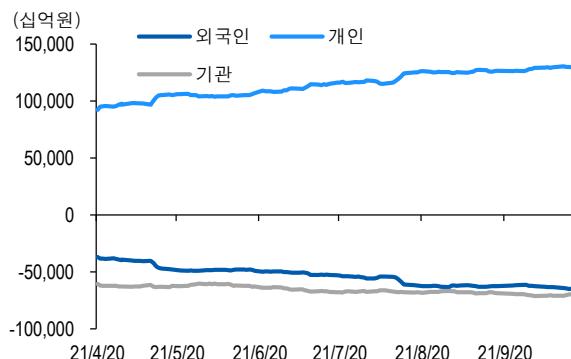
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

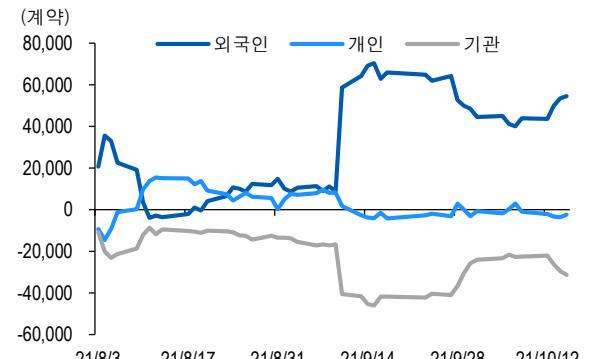
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	86.1	-13.0	73.1	-8.5	151.9	150.0	-71.7	-1.6	4.0	16.5
개인	-298.0	-83.7	-381.7	0.0	-25.6	-28.8	2.7	-0.1	-5.2	67.1
기관	211.3	95.6	306.9	-4.6	13.1	-94.0	75.6	2.9	2.6	-84.8
금융투자	123.3	137.5	260.8	-4.7	1.4	-224.3	75.5	3.1	2.8	-51.5
투신	33.1	16.9	50.0	0.0	5.9	117.1	0.0	-0.6	-0.1	20.8
은행+보험+기타금융	-4.9	-52.9	-57.8	0.0	-3.4	27.0	0.0	0.4	-0.1	0.4
연기금+국가지자체	33.7	-0.6	33.1	-5.7	9.2	-13.9	0.0	0.0	0.0	-54.6
기타법인	0.5	1.1	1.7	0.0	-2.0	-27.2	-6.5	-1.2	-1.4	1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

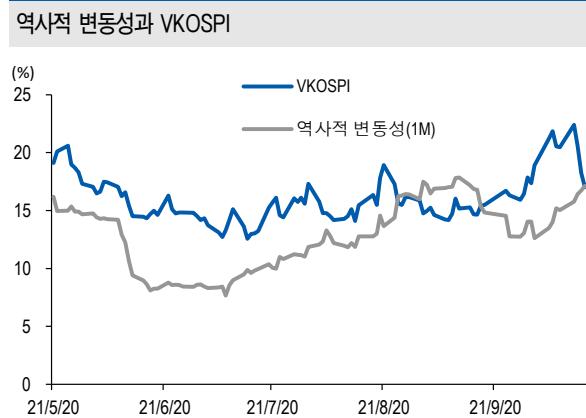


## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	432,218	180.3	573,953	15.9%	지수옵션 전체	1,026,880	383.1	1,491,065							
Put	594,662	202.8	917,112	16.3%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	17.03%(-1.18%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	5.01	1.47	6,278	4,022	306	15.6	Put	392.5(K+1)	5.95	-3.09	5,559	2,014	1,345	14.9
	395.0(K+2)	6.29	1.82	7,376	5,811	2,131	16.1		390.0(K+0)	5.04	-2.67	8,394	7,863	1,897	15.4
	392.5(K+1)	7.72	2.14	5,149	2,981	1,090	16.6		387.5(K-1)	4.19	-2.43	5,461	3,269	411	15.7
	390.0(K+0)	9.26	2.46	6,444	5,789	1,425	17.0		385.0(K-2)	3.55	-2.10	13,715	6,356	1,688	16.3
	387.5(K-1)	10.60	2.40	2,154	2,561	-463	16.7		382.5(K-3)	2.97	-1.87	14,662	6,272	664	16.7

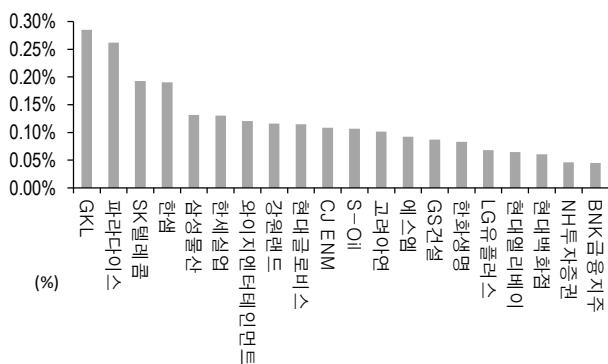
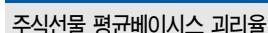
---

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 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	3,858,187	2,579.7	4,749,604	292,883	801	149,939	-154,085	16.5	67.1	-84.8		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS건설	42,500	0.83	11.7	79.0	51,545	5,406	0.09%	1,584	2,753	-4,337	-1,791	-4,912
한국조선해양	97,100	0.73	15.6	65.0	6,062	373	-0.13%	20	449	-468	-357	-107
삼성전자	70,400	1.15	785.3	63.6	1,095,639	62,336	0.01%	5,715	35,697	-41,583	-27,903	-22,500
삼성SDI	712,000	2.89	105.0	60.8	30,804	37	0.00%	255	-692	426	-388	814
호텔신라	93,000	0.54	19.6	58.9	22,090	2,034	-0.03%	2,627	-1,423	-1,204	80	-1,284
현대차	209,000	-0.48	64.7	58.5	47,153	3,834	0.04%	-972	3,092	-2,117	476	-2,367
NAVER	394,500	-0.38	100.3	57.2	48,830	2,208	-0.08%	-593	2,050	-1,515	-534	-445
현대제철	47,400	0.00	12.6	55.3	12,685	1,388	-0.02%	-1,075	278	797	1,442	-645
LG 디스플레이	18,100	2.26	50.5	54.3	240,892	18,432	-0.51%	-24,251	-662	23,309	25,877	-1,051
카카오	122,500	1.24	145.0	51.9	107,419	4,769	-0.31%	-4,823	451	4,372	5,034	-1,520

---

자료: KBX 유티즌워리 리서치센터