

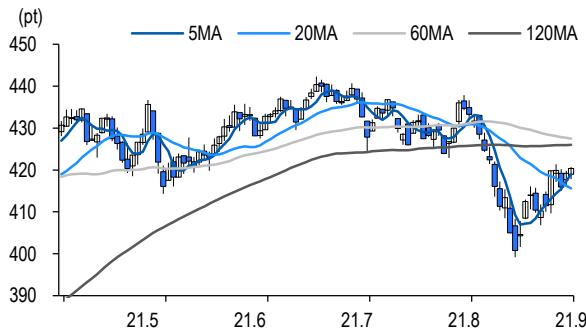


선물옵션시장 지표

2021.9.7

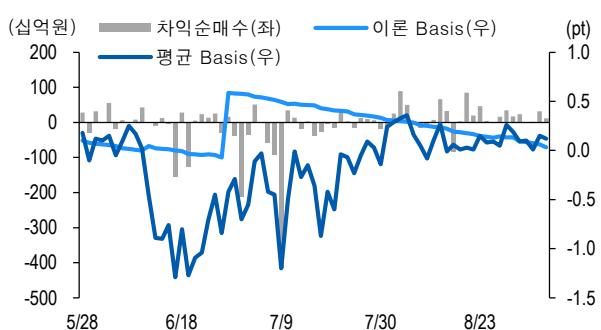
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	420.37	0.27	1.15	7,516.1	-
선물 9월물	420.15	0.24	1.00	25,159.8	204,545
선물 12월물	420.05	0.27	1.15	991.7	86,246
9월물(mini)	420.24	0.26	1.06	1,738.8	48,679
10월물(mini)	420.00	0.33	1.40	18.5	1,647



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.03	0.12	-0.22	0.02%
베이시스(mini)	0.03	0.12	-0.13	0.02%
제1스프레드(SP)	0.37	-0.23	-0.15	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	-0.17	-0.17	-0.05%



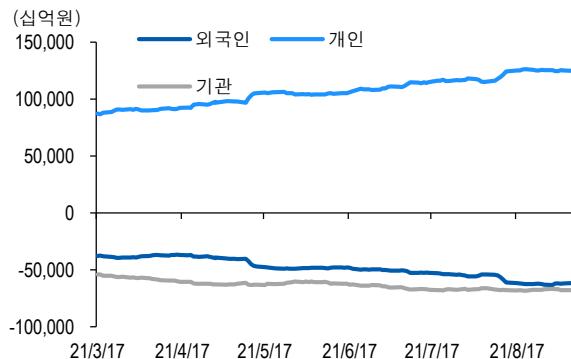
투자주체별 매매 동향

(십억원)

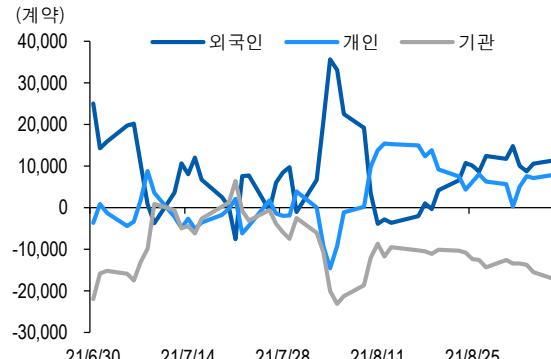
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	63.8	18.4	82.2	0.0	61.3	73.0	6.8	0.0	1.5	-18.9
개인	-97.9	-2.2	-100.1	0.0	-1.3	86.6	-5.3	1.4	-1.7	52.2
기관	45.5	-15.6	29.9	11.8	-30.9	-166.5	0.3	-0.6	1.6	-33.7
금융투자	29.7	-16.8	12.8	1.3	1.4	31.3	0.3	-0.3	1.5	-75.9
투신	-12.3	-4.7	-17.1	0.0	-14.3	-138.7	0.0	-0.4	0.0	63.9
은행+보험+기타금융	15.5	0.9	16.4	0.0	-4.2	-57.9	0.0	0.1	0.0	0.1
연기금+국가지자체	-0.3	-1.4	-1.6	0.0	-23.4	-1.2	0.0	0.0	0.0	-21.7
기타법인	-11.5	-0.6	-12.1	0.0	0.1	7.0	-1.7	-0.8	-1.3	0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,788,937	357.2	1,063,638	13.8%	지수옵션 전체	3,331,192	645.3	2,983,783
Put	1,542,255	288.1	1,920,145	15.3%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	14.24%(-0.38%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	427.5(K+3)	0.39	-0.07	296,049	44,026	6,079	14.0	422.5(K+1)
	425.0(K+2)	0.81	-0.06	335,072	42,581	2,243	13.9	420.0(K+0)
	422.5(K+1)	1.51	-0.05	250,842	29,554	2,470	13.7	417.5(K-1)
	420.0(K+0)	2.60	0.03	152,052	27,948	1,060	13.6	415.0(K-2)
	417.5(K-1)	4.08	0.14	31,160	18,643	-457	13.4	412.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	422.5(K+1)	3.81	-1.09	13,299	4,952	1,289	15.0	
	420.0(K+0)	2.40	-1.05	71,954	17,032	2,514	14.8	
	417.5(K-1)	1.39	-0.92	141,449	18,632	6,120	14.8	
	415.0(K-2)	0.77	-0.72	245,207	26,565	4,991	15.1	
	412.5(K-3)	0.40	-0.55	281,356	25,567	5,452	15.5	

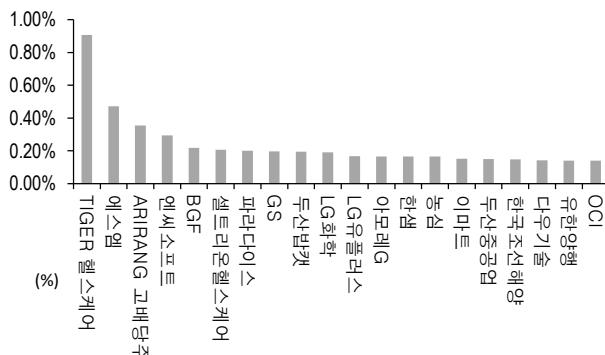
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,617,553	3,120.1	6,185,628	112,473	-30,743	49,816	-18,312	-18.9	52.2	-33.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	77,200	0.92	827.9	83.6	956,115	-111,659	0.05%	-14,095	5,305	8,919
삼성 SDI	767,000	0.79	82.2	80.1	29,531	-851	0.07%	-425	606	-344
POSCO	349,500	0.29	72.9	78.0	20,916	-464	0.09%	154	-150	-4
NAVER	453,500	0.22	115.7	69.9	48,798	-3,020	0.03%	459	-602	143
SK 텔레콤	307,000	0.33	55.2	68.1	20,557	1,222	0.10%	-574	2,121	-1,547
현대차	215,000	0.00	55.7	67.0	59,858	2,496	0.10%	1,238	-141	-1,096
SK 이노베이션	250,000	-0.20	35.0	66.3	22,996	526	0.05%	-20	920	-898
SK 하이닉스	106,000	-0.93	125.5	63.5	141,291	-1,710	0.07%	-4,974	3,231	1,748
에스엠	65,400	-0.30	23.1	61.7	59,238	9,112	0.47%	2,115	-3,219	1,104
LG 전자	147,500	-4.22	143.3	60.0	48,904	-4,837	-0.04%	-4,883	6,750	-1,866

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터