

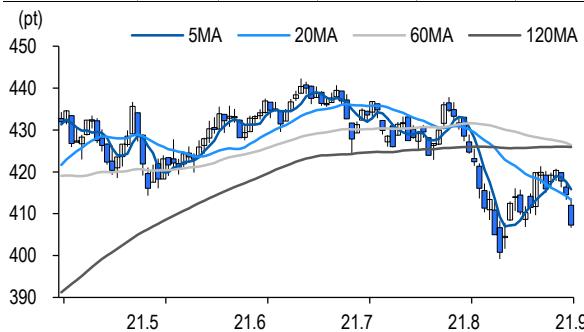


선물옵션시장 지표

2021.9.10

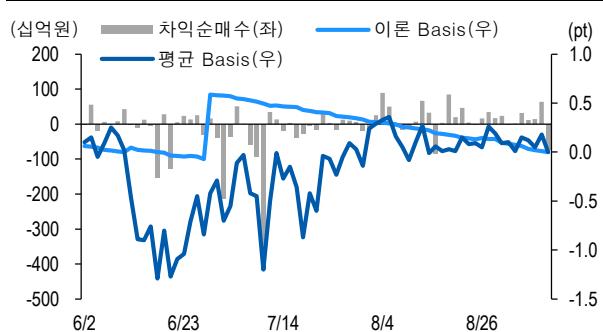
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	407.28	-1.75	-7.26	11,869.9	-
선물 9월물	407.40	-1.71	-7.10	22,174.3	0
선물 12월물	406.45	-1.75	-7.25	12,690.6	250,129
9월물(mini)	407.36	-1.72	-7.20	1,059.7	0
10월물(mini)	407.00	-1.76	-7.28	1,013.7	21,564



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	0.00	0.12	0.00%
베이시스(mini)	0.00	0.00	0.08	0.00%
제1스프레드(SP)	0.34	-0.08	-0.05	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.08	0.08	0.02%



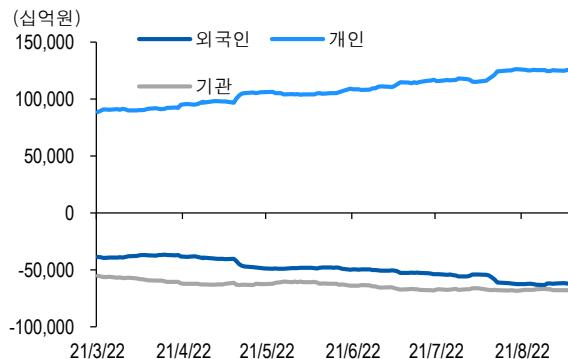
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-317.7	-8.1	-325.9	-58.1	39.5	-132.4	-95.4	11.5	-7.1	11.5
개인	1,206.6	26.4	1,233.0	0.0	5.7	-69.0	84.9	-5.5	4.9	64.0
기관	-935.0	1.1	-933.8	-15.0	-463.1	50.4	-3.6	-3.8	1.2	-76.3
금융투자	-942.1	65.1	-877.0	9.0	-505.5	294.9	-3.3	2.1	0.6	13.7
투신	158.6	4.4	163.0	0.0	34.9	-290.7	-0.4	-3.3	0.4	0.9
은행+보험+기타금융	104.9	-76.5	28.4	0.0	72.5	31.8	0.1	-2.6	0.2	0.0
연기금+국가지자체	-185.4	-3.5	-188.9	-24.0	-24.6	14.3	0.0	0.0	0.0	-90.9
기타법인	46.1	-19.4	26.7	0.0	0.4	151.0	14.1	-2.2	1.0	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

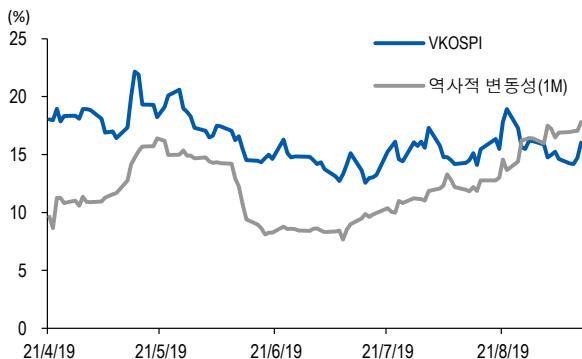
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	2,783,954	324.0	466,850	12.4%	지수옵션 전체	5,798,470	895.9	1,237,546						
Put	3,014,516	571.8	770,696	5.6%	PCR(금액기준)	1.76	VKOSPI	16.02%(+1.29%p)						
<hr/>														
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	422.5(K+3)	0.01	-0.04	62,869	0	-41,285	27.4	Put						
	420.0(K+2)	0.01	-0.12	129,391	0	-55,578	23.4	417.5(K+1)	10.05	6.60	9,589	0	-18,222	0.3
	417.5(K+1)	0.01	-0.44	275,963	0	-29,436	19.4	415.0(K+0)	7.65	5.85	56,206	0	-25,414	20.6
	415.0(K+0)	0.01	-1.33	617,587	0	-22,352	15.2	412.5(K-1)	5.11	4.33	204,385	0	-26,302	0.1
	412.5(K-1)	0.01	-2.81	630,382	0	-11,469	10.8	410.0(K-2)	2.67	2.34	515,483	0	-40,266	9.5
	407.5(K-3)	0.41	0.28	885,192	0	-43,931	3.4							

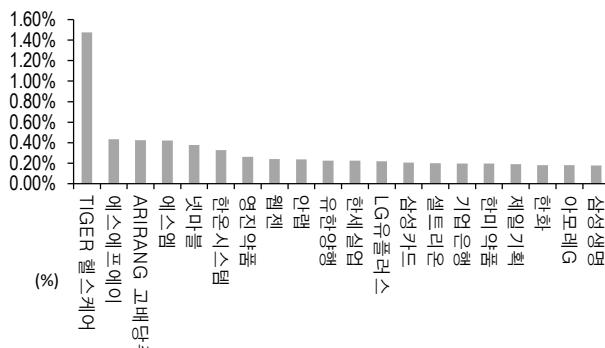
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역사적 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	5,436,669	4,919.6	5,018,556	-1,490,324	32,310	59,680	-90,119	11.5	64.0	-76.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
와이저엔터	56,400	0.00	8.2	45.5	0	-14,860	0.06%	2,824	1,423	-4,247	-2,580	0
POSCO	359,500	-0.55	75.4	43.7	0	-16,696	-0.12%	-371	385	-24	-2,520	2,125
삼성전자	75,000	-1.57	508.3	38.3	0	-491,555	-0.08%	-4,706	-5,003	9,166	30,475	-18,605
삼성 SDI	753,000	-2.08	87.1	35.8	0	-13,063	0.05%	-182	1,720	-1,526	-701	-1,080
KT	32,750	0.31	12.3	32.4	0	-31,654	0.05%	7,063	-3,033	-3,999	-2,145	-2,750
넷마블	122,500	-2.39	9.2	31.6	0	-8,814	0.38%	-1,126	-201	1,327	890	-298
호텔신라	87,900	-1.57	9.6	30.9	0	-13,034	0.09%	551	-2,370	1,888	3,300	-1,471
SK 하이닉스	103,000	-2.37	97.1	29.2	0	-98,640	0.16%	-8,197	6,024	2,133	5,001	2,400
GS건설	44,500	-0.78	8.4	28.7	0	-20,085	0.02%	3,556	-62	-3,494	2,461	-5,680
에스엠	63,700	-0.47	16.2	28.4	0	-48,659	0.42%	-2,672	-8,101	10,875	-2,928	0

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터