

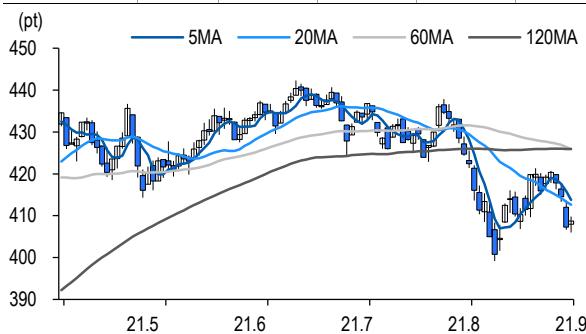


## 선물옵션시장 지표

2021.9.13

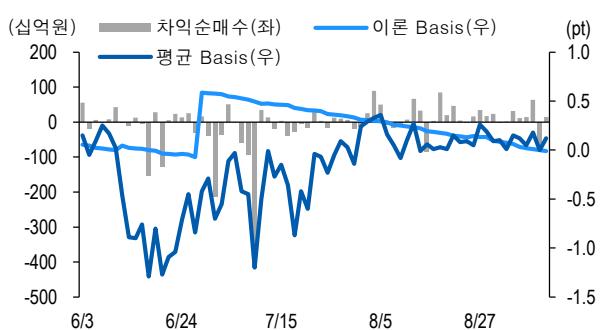
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	408.70	0.35	1.42	9,555.7	-
선물 12월물	408.20	0.43	1.75	26,310.9	252,660
선물 3월물	405.00	0.43	1.75	20.8	8,172
10월물(mini)	407.80	0.20	0.80	1,998.0	28,722
11월물(mini)	407.94	0.35	1.42	1.3	146



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-0.01	0.12	-0.50	0.03%
베이시스(mini)	-0.01	-0.28	-0.90	-0.07%
제1스프레드(SP)	-3.10	-3.53	-3.15	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.01	-0.90	-0.90	-0.22%



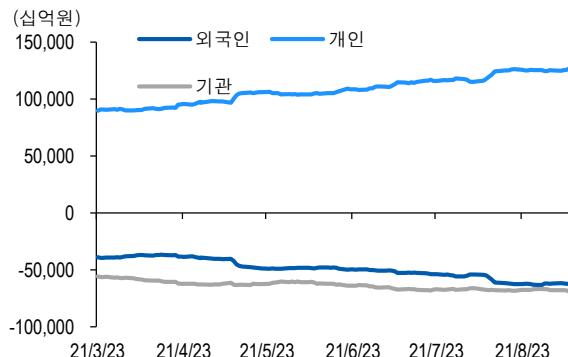
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

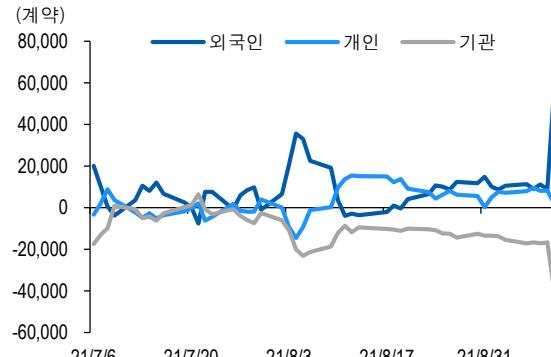
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-518.2	-19.6	-537.8	0.0	-399.1	234.4	-0.6	2.0	-1.7	82.0
개인	280.7	-1.9	278.8	0.0	6.2	-145.3	-13.1	-4.1	-1.8	34.4
기관	238.3	18.0	256.2	14.8	-152.3	61.8	11.9	2.4	3.3	-117.2
금융투자	340.6	82.1	422.8	-1.6	30.7	-153.0	11.8	3.6	3.6	-86.2
투신	11.1	7.4	18.5	0.0	-0.4	260.8	0.0	-0.6	-0.2	27.7
은행+보험+기타금융	5.9	-65.8	-59.9	0.0	2.3	-28.5	0.0	-0.5	0.0	1.0
연기금+국가지자체	-130.9	-6.0	-136.9	16.4	-185.1	-17.5	0.0	0.0	0.0	-59.6
기타법인	-0.8	3.5	2.7	0.0	0.8	-150.9	1.9	-0.3	0.1	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

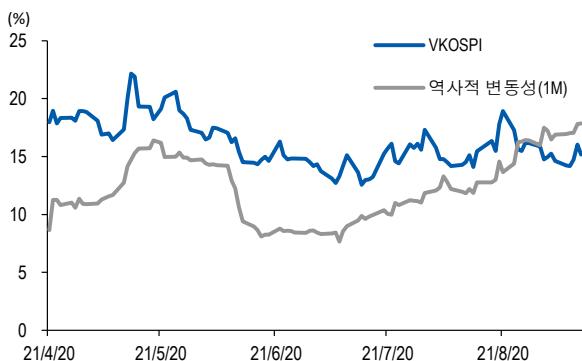
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	510,739	194.5	529,843	13.0%	지수옵션 전체	1,127,473	442.1
Put	616,734	247.6	864,339	15.4%	PCR(금액기준)	1.27	VKOSPI 15.18%(-0.84%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	415.0(K+3)	3.86	0.12	21,637	3,574	926	13.0
	412.5(K+2)	4.81	0.21	10,616	2,940	774	13.1
	410.0(K+1)	5.99	0.30	9,912	3,992	1,101	13.3
	407.5(K+0)	7.30	0.37	6,154	2,447	1,471	13.5
	405.0(K-1)	9.01	0.46	2,176	953	382	14.2
Put	410.0(K+1)	8.15	-1.35	3,611	6,233	421	14.6
	407.5(K+0)	7.00	-1.19	7,321	3,859	594	14.8
	405.0(K-1)	5.96	-1.13	5,971	4,183	163	15.1
	402.5(K-2)	5.08	-1.03	12,595	2,945	346	15.4
	400.0(K-3)	4.30	-0.90	14,909	12,530	-681	15.7

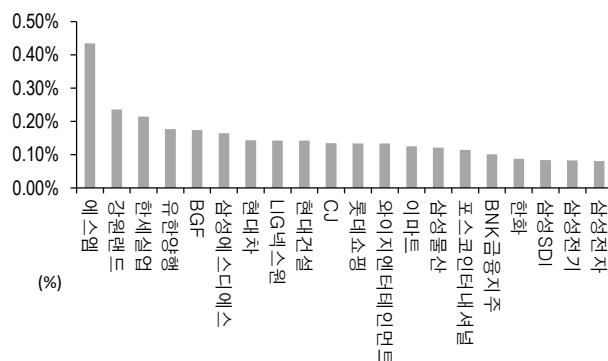
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,217,656	2,987.0	5,278,635	260,079	101,143	87,773	-187,937	82.0	34.4	-117.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영진약품	5,400	-0.74	1.7	81.7	7,053	2,016	0.00%	-748	114	634
삼성전자	75,200	0.00	597.0	78.8	1,145,048	15,522	0.08%	42,385	8,705	-51,090
삼성SDI	751,000	0.13	96.1	70.8	29,003	651	0.08%	747	768	-1,484
SK 이노베이션	250,000	0.81	65.1	68.0	18,577	2,202	-0.01%	3,039	-387	-2,684
KT	32,850	0.31	12.4	61.4	62,837	932	0.05%	992	2,593	-3,964
S-Oil	96,300	-1.03	11.5	59.6	8,646	1,087	-0.08%	693	255	-948
현대건설	53,500	1.13	12.1	59.3	16,332	3,531	0.14%	4,197	246	-4,481
현대차	206,500	-0.96	80.0	57.5	55,790	2,483	0.14%	2,569	-1,852	-749
삼성증권	49,250	1.13	4.7	56.0	12,638	1,624	0.02%	-168	2,272	-2,103
호텔신라	88,200	0.57	8.7	55.5	18,034	738	-0.03%	-958	-313	1,254

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터