

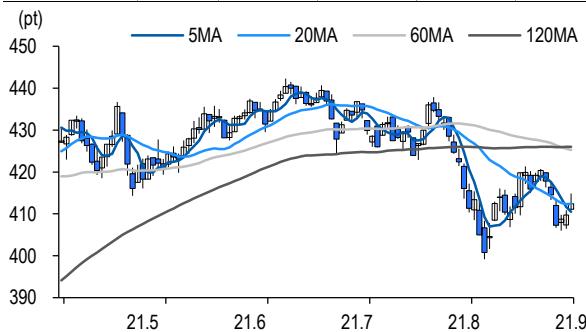


## 선물옵션시장 지표

2021.9.15

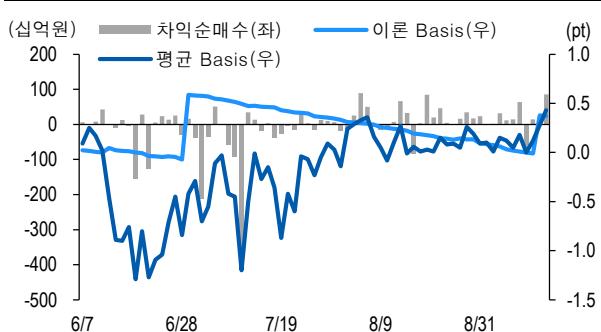
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.36	0.65	2.66	11,635.8	-
선물 12월물	412.60	0.71	2.90	24,712.1	259,352
선물 3월물	408.80	0.66	2.70	27.9	7,829
10월물(mini)	412.04	0.71	2.90	1,815.8	45,358
11월물(mini)	412.30	0.61	2.50	3.1	1,671



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.37	0.43	0.24	0.01%
베이시스(mini)	-0.26	-0.20	-0.32	0.01%
제1스프레드(SP)	-2.98	-3.71	-3.70	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.26	-0.36	-0.36	-0.02%



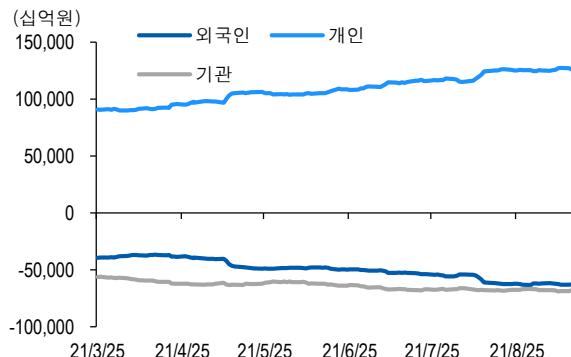
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	293.9	17.5	311.3	-7.7	342.8	639.6	-129.8	-1.1	3.1	-7.7
개인	-1,067.0	-71.6	-1,138.5	0.0	-2.9	-76.2	-27.2	2.7	-2.3	-21.7
기관	764.0	47.0	811.0	93.2	94.3	-546.0	163.5	-1.5	-0.7	29.7
금융투자	584.5	146.7	731.2	95.4	142.9	-740.4	163.5	-1.6	-0.8	-20.7
투신	78.3	-6.2	72.1	0.0	-6.0	196.2	0.0	0.1	0.0	57.7
은행+보험+기타금융	7.9	-77.1	-69.2	2.1	-5.8	-5.1	0.0	0.1	0.1	0.2
연기금+국가지자체	-6.9	-10.2	-17.1	-4.3	-45.9	3.3	0.0	0.0	0.0	-7.4
기타법인	9.1	7.1	16.2	0.0	0.0	-17.4	-6.4	-0.1	-0.1	-0.3

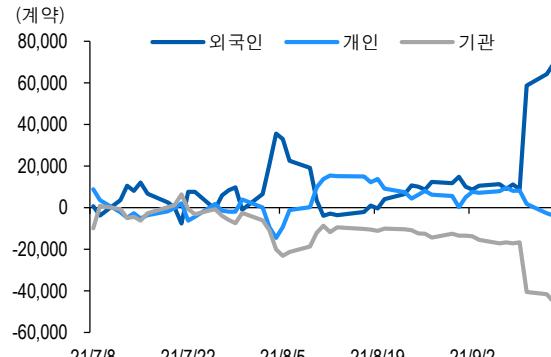
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



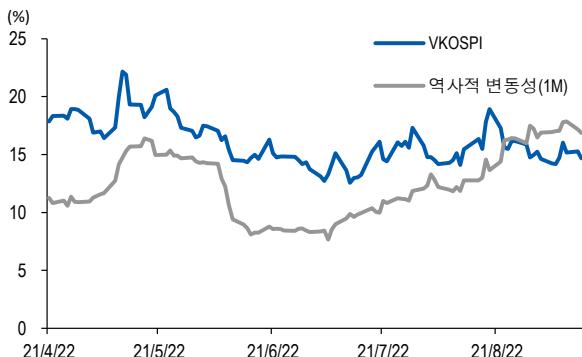
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	611,926	243.8	577,496	12.8%	지수옵션 전체	1,112,711	420.8	1,509,401
Put	500,785	177.0	931,905	14.7%	PCR(금액기준)	0.73	VKOSPI	14.67%(-0.61%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	417.5(K+3)	3.85	0.68	21,138	6,601	-426	12.8	412.5(K+1)
	415.0(K+2)	4.93	0.82	14,535	5,252	407	13.0	410.0(K+0)
	412.5(K+1)	6.24	1.06	8,261	3,812	604	13.4	407.5(K-1)
	410.0(K+0)	7.68	1.24	3,323	5,341	423	13.8	405.0(K-2)
	407.5(K-1)	9.26	1.41	1,250	2,636	-162	14.1	402.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	412.5(K+1)	6.75	-1.73	6,484	2,788	1,061	13.7	410.0(K+0)
	410.0(K+0)	5.68	-1.57	10,462	7,686	915	14.0	407.5(K-1)
	407.5(K-1)	4.77	-1.40	7,737	4,540	331	14.3	405.0(K-2)
	405.0(K-2)	3.96	-1.24	13,726	5,220	420	14.6	402.5(K-3)
	402.5(K-3)	3.29	-1.11	14,247	4,076	991	15.0	

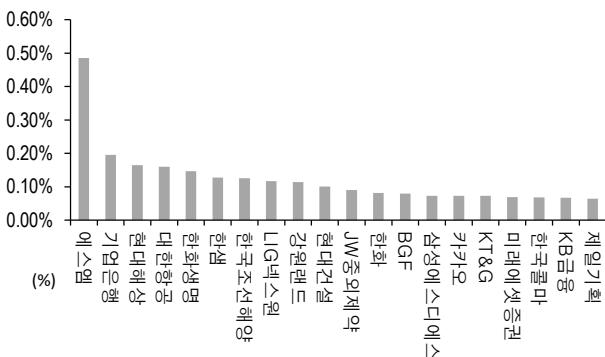
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	4,211,719	3,766.4	5,457,440	166,180	-13,978	21,034	-15,590	-7.7	-21.7	29.7	
<hr/>											
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성전자	76,500	0.66	1,017.8	72.7	1,134,506	-11,683	0.05%	2,961	-15,112	12,151	-4,260
삼성 SDI	758,000	2.16	103.3	69.7	30,905	821	0.05%	534	179	-748	-433
현대차	209,500	1.95	100.4	66.6	54,898	497	0.04%	503	507	-1,007	-240
현대제철	53,300	-1.66	20.9	58.1	29,524	-1,729	0.00%	-2,723	717	1,999	-524
POSCO	363,000	-2.42	88.2	58.0	23,819	778	-0.63%	-2,691	1,338	1,264	-320
NAVER	402,500	-1.23	331.9	51.4	62,396	-9,816	-0.03%	-345	-9,722	10,387	6,366
호텔신라	90,500	4.26	30.3	48.9	21,620	-776	0.04%	2,188	276	-2,425	-2,476
한국금융지주	88,600	0.80	7.7	48.5	36,138	-596	-0.03%	1,056	-167	-720	-1,105
LG 디스플레이	20,350	0.99	18.5	48.4	335,117	-5,838	-0.06%	4,375	-6,311	1,941	-2,393
SK 텔레콤	302,500	0.33	20.7	47.7	22,826	13	-0.69%	-578	114	464	6

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터