

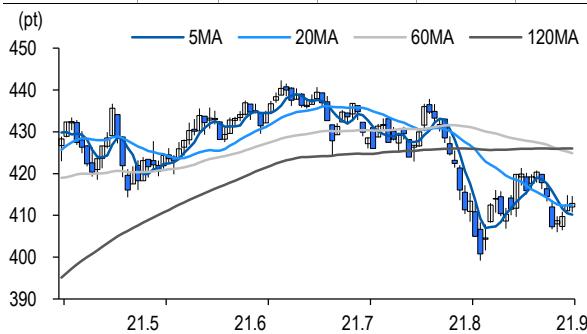


선물옵션시장 지표

2021.9.16

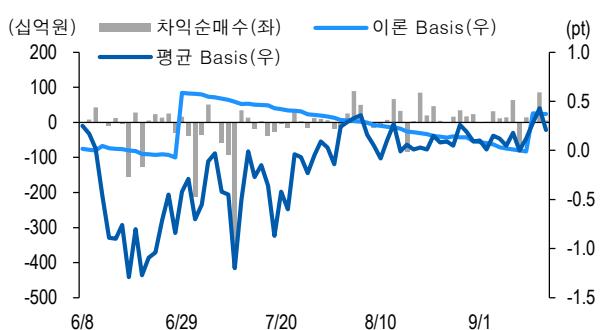
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.85	0.12	0.49	9,152.8	-
선물 12월물	413.00	0.10	0.40	27,871.9	253,057
선물 3월물	409.40	0.15	0.60	27.8	7,688
10월물(mini)	412.50	0.11	0.46	1,982.2	43,214
11월물(mini)	413.10	0.19	0.80	3.6	1,728



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.37	0.21	0.15	-0.04%
베이시스(mini)	-0.27	-0.34	-0.35	-0.02%
제1스프레드(SP)	-2.95	-3.84	-3.85	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.27	-0.36	-0.36	-0.02%



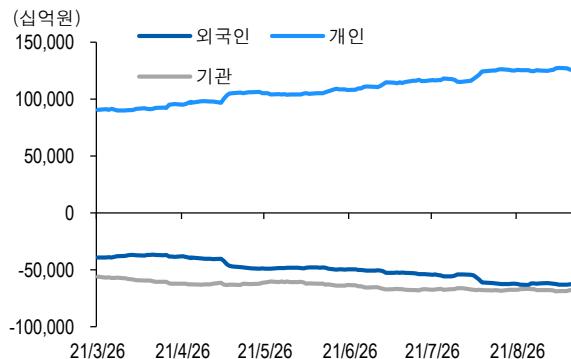
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	294.2	-16.0	278.2	-1.0	261.1	58.2	63.1	1.9	-1.3	21.0
개인	-183.7	88.2	-95.5	0.0	-3.4	-26.8	-13.9	-1.0	-1.0	4.3
기관	-141.2	-68.6	-209.8	6.5	-6.8	-48.0	-43.2	-0.7	2.6	-26.9
금융투자	-124.1	-96.4	-220.6	4.4	4.2	139.1	-43.3	-0.8	2.9	-21.6
투신	-18.9	-4.5	-23.4	2.1	-23.2	-157.0	0.1	-0.1	-0.1	3.5
은행+보험+기타금융	-28.3	38.2	9.8	0.0	-24.2	-32.5	0.0	0.2	-0.2	1.5
연기금+국가지자체	31.4	-2.1	29.4	0.0	38.9	2.3	0.0	0.0	0.0	-10.2
기타법인	30.7	-3.6	27.1	0.0	0.1	16.7	-6.0	-0.1	-0.3	1.6

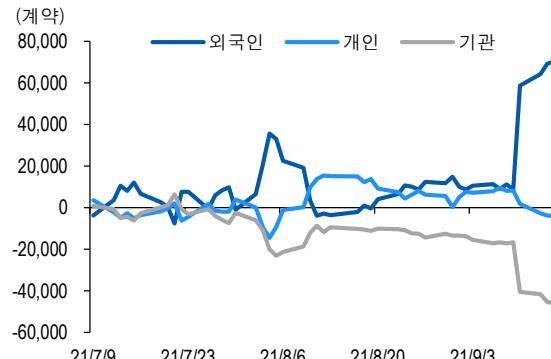
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	571,396	213.3	593,887	12.6%	지수옵션 전체	1,050,773	402.6
Put	479,377	189.4	959,288	14.3%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI 14.66%(-0.01%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	3.01	0.05	37,453	15,116	714	12.6
	417.5(K+2)	3.91	0.06	18,298	7,025	424	12.7
	415.0(K+1)	5.08	0.15	15,692	5,579	327	13.1
	412.5(K+0)	6.33	0.09	5,815	3,832	20	13.3
	410.0(K-1)	7.83	0.15	3,213	5,228	-113	13.7
Put	415.0(K+1)	7.52	-0.47	3,119	3,179	125	13.2
	412.5(K+0)	6.34	-0.41	6,935	2,916	128	13.6
	410.0(K-1)	5.32	-0.36	7,676	8,041	355	13.9
	407.5(K-2)	4.40	-0.37	8,370	4,570	30	14.2
	405.0(K-3)	3.65	-0.31	14,051	5,925	705	14.5

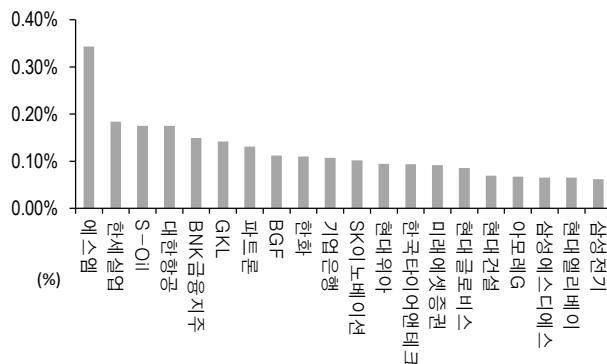
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,426,238	3,036.5	5,576,780	119,340	2,169	48,829	-57,098	21.0	4.3	-26.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성 SDI	753,000	-0.66	71.4	78.7	31,222	317	0.04%	-193	-22	215
삼성전자	76,800	0.39	755.2	78.4	1,122,913	-11,593	0.04%	5,144	6,758	-12,757
호텔신라	90,100	-0.44	19.7	69.7	25,223	3,603	-0.07%	-597	1,450	-813
하나금융지주	45,150	-0.11	30.0	67.9	151,967	5,648	-0.01%	-7,698	340	7,358
기아	83,400	-0.12	57.2	61.2	51,134	1,973	-0.01%	629	751	-1,380
현대차	209,500	0.00	55.5	56.1	51,235	-3,663	-0.06%	-2,069	-2,651	4,720
대한항공	32,650	0.46	50.0	55.6	200,571	23,685	0.18%	-7,220	1,178	6,049
SK 이노베이션	249,500	-2.54	106.6	55.3	22,457	772	0.10%	100	-870	635
현대엘리베이	49,100	0.31	3.4	54.6	17,328	827	0.07%	312	547	-859
카카오	123,000	-0.81	614.3	54.4	141,382	1,051	-0.01%	429	-1,586	1,163

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터