

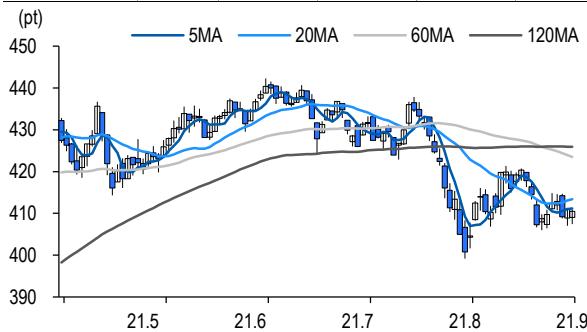


선물옵션시장 지표

2021.9.24

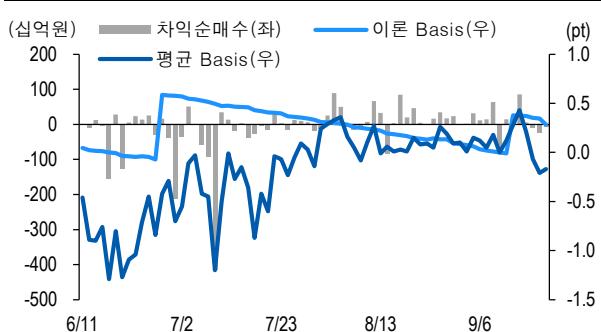
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	410.46	-0.13	-0.53	9,737.3	-
선물 12월물	409.55	-0.29	-1.20	27,357.5	251,407
선물 3월물	405.90	-0.17	-0.70	56.1	7,449
10월물(mini)	409.16	-0.28	-1.14	2,373.3	47,025
11월물(mini)	409.18	-0.30	-1.24	2.8	1,733



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.28	-0.17	-0.91	-0.11%
베이시스(mini)	-0.36	-0.61	-1.30	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.95	-3.93	-4.05	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.36	-1.31	-1.31	-0.23%

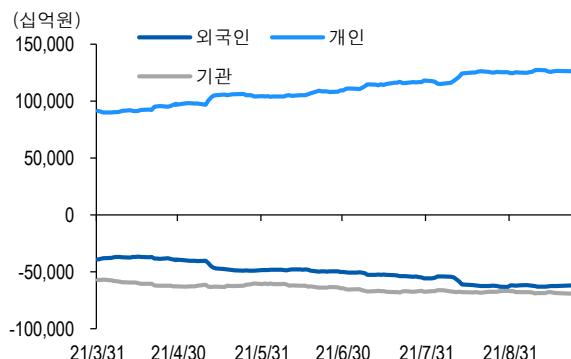


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	553.1	12.2	565.4	0.0	219.5	-78.7	-38.1	-0.7	0.9	11.5
개인	-310.3	103.1	-207.2	0.0	-3.9	185.5	-28.9	-1.2	0.1	-11.0
기관	-227.1	-134.5	-361.5	-6.2	-32.8	-94.2	57.1	2.2	-1.0	-1.0
금융투자	-0.6	-219.9	-220.5	-12.4	0.7	98.4	57.0	2.3	-1.3	0.7
투신	-94.8	5.8	-89.0	0.0	-22.7	-171.2	0.1	-0.1	0.4	7.2
은행+보험+기타금융	-39.4	78.8	39.4	0.0	-16.3	-14.3	0.0	0.1	0.0	1.5
연기금+국가지자체	20.0	-2.7	17.2	6.2	6.3	-7.1	0.0	0.0	0.0	-10.4
기타법인	-15.7	19.2	3.4	0.0	0.2	-12.6	9.9	-0.3	0.0	0.5

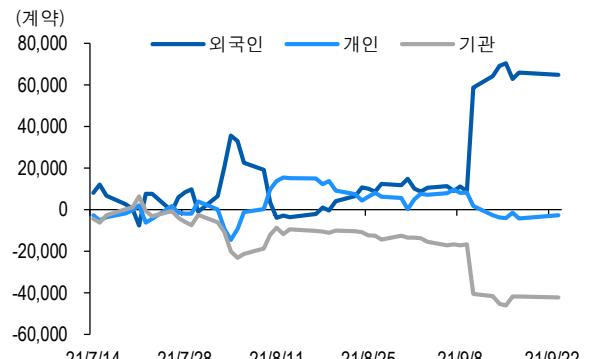
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



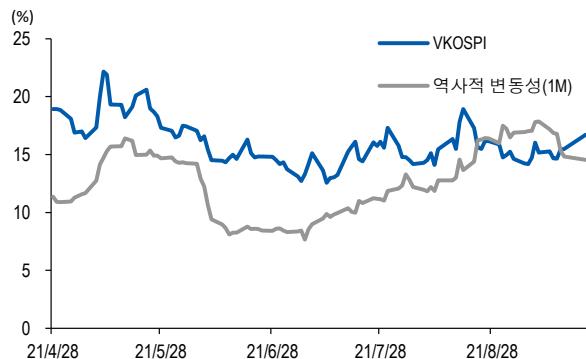
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	590,500	204.0	652,099	13.2%	지수옵션 전체	1,164,547	411.7	1,681,034
Put	574,047	207.7	1,028,935	17.1%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	16.72%(+1.24%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	417.5(K+3)	2.46	-0.64	51,774	9,462	533	13.2	412.5(K+1)
	415.0(K+2)	3.33	-0.71	30,031	7,535	430	13.4	410.0(K+0)
	412.5(K+1)	4.38	-0.80	15,863	4,913	735	13.6	407.5(K-1)
	410.0(K+0)	5.60	-0.87	14,802	6,619	1,270	13.8	405.0(K-2)
	407.5(K-1)	7.03	-0.96	4,577	4,166	710	14.1	402.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	412.5(K+1)	7.73	0.35	1,496	3,248	164	16.1	410.0(K+0)
	410.0(K+0)	6.45	0.26	6,903	8,236	597	16.2	407.5(K-1)
	407.5(K-1)	5.40	0.16	6,490	6,143	344	16.6	405.0(K-2)
	405.0(K-2)	4.45	-0.04	9,436	5,826	138	16.8	402.5(K-3)
	402.5(K-3)	3.72	0.02	12,267	5,435	279	17.3	

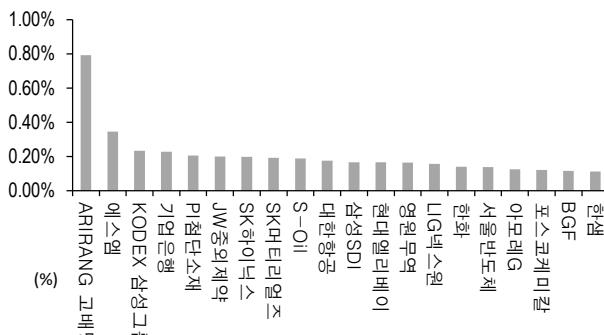
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,289,422	2,817.8	5,736,861	50,808	-2,641	20,903	-20,245	11.5	-11.0	-1.0
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
영진약품	5,310	-1.12	1.0	76.5	7,280	355	-0.13%	1,986	328	-2,315
삼성 SDI	732,000	0.55	103.4	59.7	37,693	666	0.17%	-92	957	-865
롯데케미칼	258,000	-2.09	24.2	59.0	7,015	-2,396	-0.21%	-561	-830	1,391
SK 이노베이션	245,500	2.29	64.1	58.4	21,605	-774	0.02%	994	-1,429	470
삼성전자	77,000	0.13	711.6	54.2	1,126,735	-11,107	-0.02%	-22,158	3,153	18,948
현대차	208,000	-0.48	57.1	52.8	45,522	409	0.06%	1,254	-234	-1,020
하나금융지주	44,350	-0.11	18.2	51.4	150,023	-2,922	-0.02%	1,109	578	-1,721
기아	84,200	0.12	50.8	50.9	46,762	1,074	0.00%	540	-880	390
GS건설	44,950	-2.71	13.6	47.0	51,724	-3,921	0.00%	-1,178	-1,758	2,936
셀트리온	284,000	3.27	165.6	47.0	35,101	-744	0.01%	2,157	-3,103	946

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터