

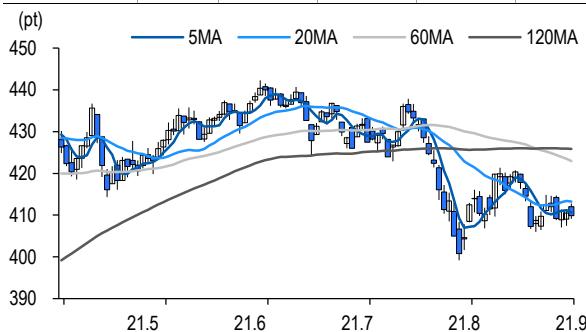


선물옵션시장 지표

2021.9.27

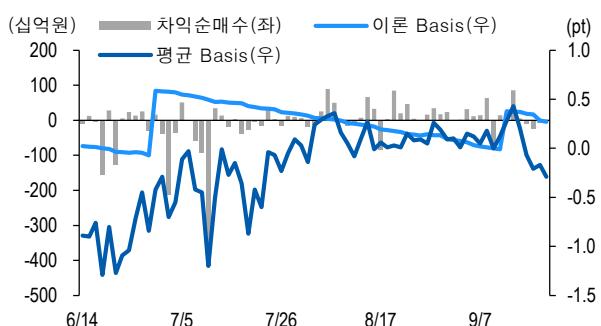
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	409.84	-0.15	-0.62	8,491.5	-
선물 12월물	409.25	-0.07	-0.30	25,564.7	255,721
선물 3월물	405.75	-0.04	-0.15	10.1	7,445
10월물(mini)	408.92	-0.06	-0.24	2,042.5	53,331
11월물(mini)	408.92	-0.06	-0.26	3.1	1,627



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.27	-0.29	-0.59	-0.14%
베이시스(mini)	-0.37	-0.62	-0.92	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.94	-3.95	-3.90	-0.25%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.37	-0.96	-0.96	-0.14%



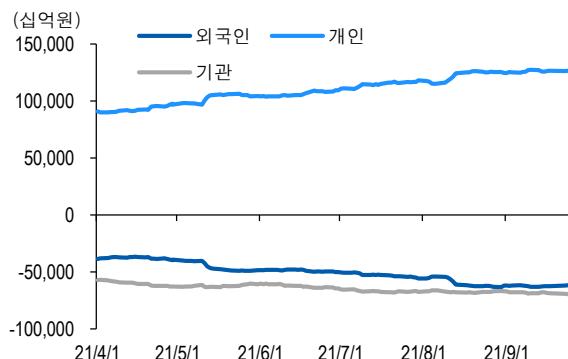
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	77.1	18.6	95.6	0.0	-78.6	-349.0	55.1	1.2	-1.7	-45.0
개인	254.6	16.0	270.5	0.0	0.8	96.7	-4.0	0.0	0.1	41.1
기관	-341.7	-31.7	-373.4	-1.5	-33.7	239.1	-49.6	-0.9	1.6	4.3
금융투자	-207.9	15.7	-192.2	-5.7	-5.7	182.9	-47.8	1.1	1.0	10.3
투신	-30.2	29.5	-0.7	0.0	-12.2	21.5	-1.7	0.0	0.2	-8.3
은행+보험+기타금융	-28.0	-69.1	-97.1	0.0	-15.7	39.1	-0.1	-2.0	0.4	0.3
연기금+국가지자체	-25.4	-3.0	-28.4	4.1	5.9	-4.4	0.0	0.0	0.0	2.0
기타법인	10.0	-2.8	7.2	0.0	1.0	13.2	-1.4	-0.2	0.0	-0.4

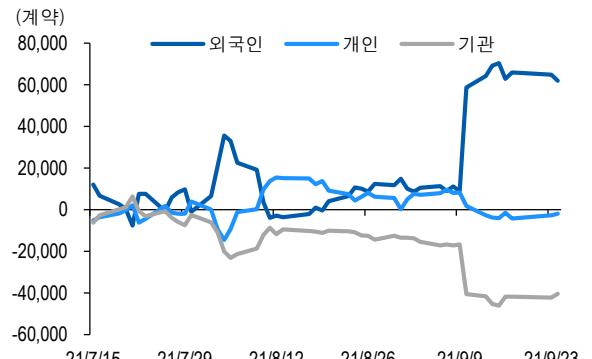
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



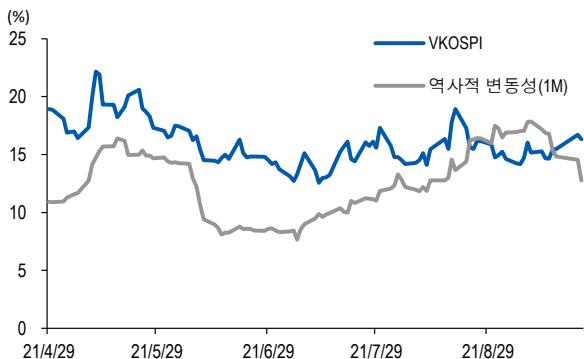
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	584,256	186.2	680,795	12.9%	지수옵션 전체	1,168,056	380.5
Put	583,800	194.3	1,054,522	16.1%	PCR(금액기준)	1.04	VKOSPI 16.33%(-0.39%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	417.5(K+3)	2.07	-0.39	44,207	10,786	1,324	12.9
	415.0(K+2)	2.89	-0.44	32,595	8,597	1,062	13.2
	412.5(K+1)	3.87	-0.51	12,422	5,712	799	13.3
	410.0(K+0)	5.08	-0.52	9,360	8,442	1,823	13.6
	407.5(K-1)	6.52	-0.51	2,697	4,421	255	14.0
Put	412.5(K+1)	7.47	-0.26	2,937	3,528	280	14.9
	410.0(K+0)	6.20	-0.25	9,452	9,487	1,251	15.2
	407.5(K-1)	5.12	-0.28	8,655	7,356	1,213	15.5
	405.0(K-2)	4.20	-0.25	14,395	6,300	474	15.9
	402.5(K-3)	3.45	-0.27	17,936	5,908	473	16.3

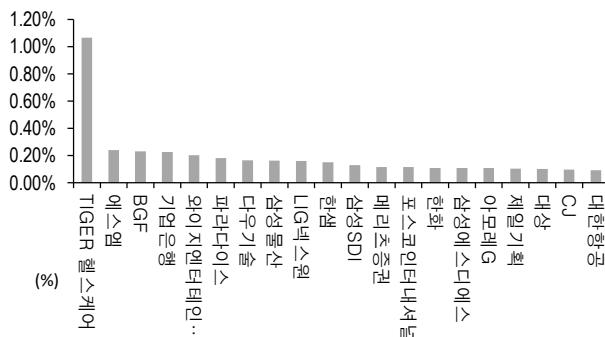
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,045,043	2,664.8	5,755,892	19,031	-52,436	56,115	-3,631	-45.0	41.1	4.3	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성 SDI	725,000	-0.96	90.3	75.7	37,867	174	0.13%	345	356	-699	-1,031
현대제철	48,700	0.10	38.5	75.6	19,407	-544	-0.02%	1,788	1,182	-2,962	1,664
하나금융지주	44,950	1.35	27.3	72.2	149,625	-398	-0.01%	3,474	-367	-3,009	-2,734
삼성전자	77,000	0.00	640.9	69.8	1,128,800	2,065	-0.04%	-17,230	20,357	-3,124	1,234
NAVER	406,000	1.63	150.2	65.0	62,315	2,881	0.00%	2,309	28	-2,361	-314
SK 하이닉스	104,000	-1.89	139.1	60.2	131,695	8,633	0.07%	-5,621	10,241	-4,620	-1,435
현대차	207,000	-0.48	49.1	57.5	45,540	18	0.04%	-2,582	703	1,879	1,228
SK 이노베이션	248,500	1.22	56.1	56.9	21,018	-587	-0.05%	-161	-288	459	-595
GS건설	44,400	-1.22	13.8	56.9	50,019	-1,705	0.01%	2,006	-2,052	46	-1,984
KT	32,450	-0.31	9.8	54.4	63,950	2,524	0.05%	-3,455	4,917	-1,463	-1,774

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터