

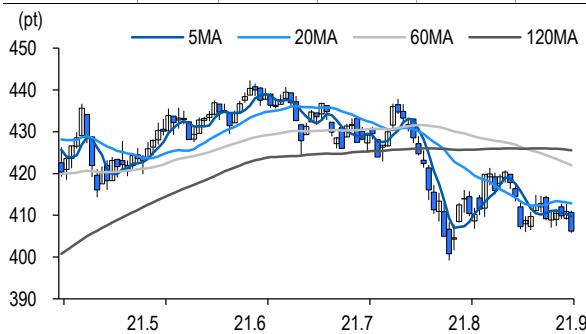


선물옵션시장 지표

2021.9.29

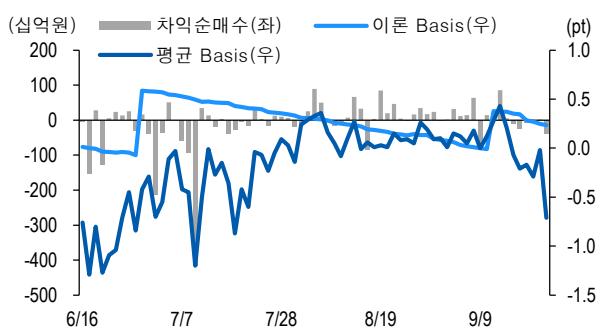
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	406.20	-1.16	-4.77	10,013.6	-
선물 12월물	404.90	-1.41	-5.80	25,609.5	266,570
선물 3월물	401.65	-1.22	-4.95	16.9	7,441
10월물(mini)	404.62	-1.39	-5.70	2,329.2	62,510
11월물(mini)	405.10	-1.31	-5.38	6.0	2,474



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.23	-0.71	-1.30	-0.23%
베이시스(mini)	-0.41	-0.92	-1.58	-0.12%
제1스프레드(SP)	-2.94	-3.85	-3.80	-0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.41	-1.50	-1.50	-0.27%



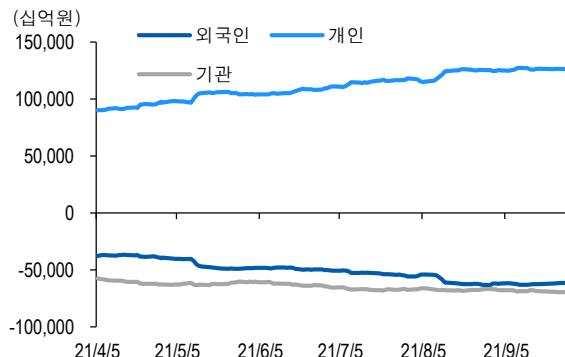
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	10.5	-35.8	-25.3	-0.2	-16.4	-1,157.6	-13.0	-0.6	1.8	-56.7
개인	560.6	55.8	616.4	0.0	-1.2	523.0	88.5	-2.0	0.4	10.8
기관	-555.5	-20.2	-575.7	-37.7	-59.1	551.1	-102.2	3.3	-2.0	45.6
금융투자	-515.2	-114.7	-629.9	-13.0	-2.9	917.3	-102.0	1.6	0.3	62.5
투신	14.2	32.4	46.7	-6.1	-14.0	-357.9	0.0	0.0	0.1	-43.6
은행+보험+기타금융	-72.9	56.6	-16.3	0.0	-61.1	-25.5	-0.2	1.6	-2.5	-1.8
연기금+국가지자체	-28.3	-0.7	-28.9	-18.7	21.9	17.1	0.0	0.0	0.0	28.4
기타법인	-15.6	0.2	-15.4	0.0	0.4	83.5	26.7	-0.7	-0.2	0.3

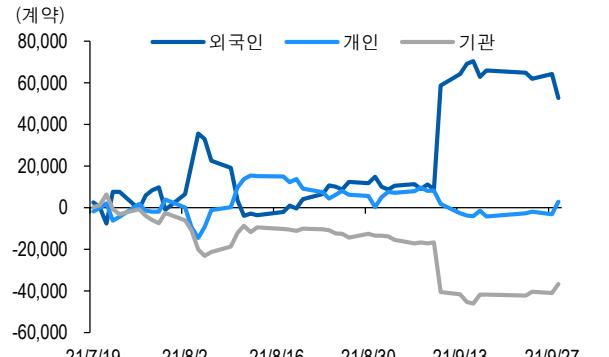
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	797,809	178.3	744,230	12.3%	지수옵션 전체	1,547,924	442.5	1,849,639
Put	750,115	264.3	1,105,409	16.4%	PCR(금액기준)	1.48	VKOSPI	16.45% (+0.53%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	417.5(K+3)	0.78	-1.29	83,197	15,939	4,699	12.2	412.5(K+1)
	415.0(K+2)	1.22	-1.70	61,911	15,014	4,959	12.3	410.0(K+0)
	412.5(K+1)	1.86	-2.11	41,149	7,921	1,499	12.6	407.5(K-1)
	410.0(K+0)	2.67	-2.62	38,490	12,861	3,994	12.7	405.0(K-2)
	407.5(K-1)	3.67	-3.10	10,687	5,867	1,362	12.8	402.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	412.5(K+1)	9.66	3.47	2,686	3,958	225	16.2	
	410.0(K+0)	7.97	2.98	8,513	10,511	384	16.0	
	407.5(K-1)	6.45	2.46	9,843	8,043	249	15.9	
	405.0(K-2)	5.20	2.02	20,070	7,767	98	16.0	
	402.5(K-3)	4.20	1.69	30,985	6,366	-224	16.4	

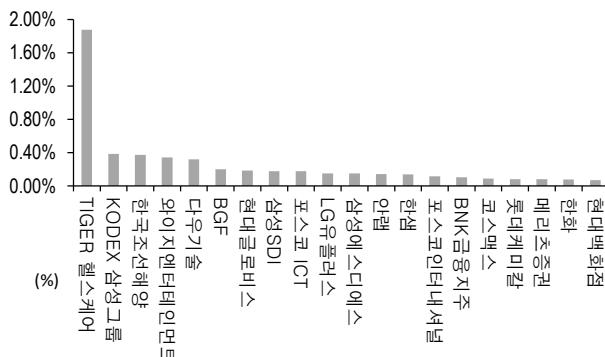
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,917,031	3,147.4	5,811,579	40,485	-62,344	32,391	29,976	-56.7	10.8	45.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
현대제철	48,200	-1.23	32.8	72.0	19,731	-364	-0.01%	921	-358	-563
삼성전자	76,000	-1.55	765.0	68.7	1,125,909	9,545	-0.04%	-26,293	-1,370	26,524
GS건설	43,250	-2.26	14.6	66.2	52,024	236	0.04%	2,539	-2,463	204
카카오	117,000	-3.31	263.1	64.8	145,610	-1,376	0.00%	-4,481	1,879	2,672
롯데케미칼	264,000	2.72	45.2	64.5	8,207	1,823	0.08%	183	877	-980
삼성 SDI	717,000	-2.71	109.4	62.3	40,190	1,020	0.18%	-904	1,785	-887
하나금융지주	45,600	2.13	48.0	60.5	134,919	-14,694	-0.12%	356	140	-653
SK 하이닉스	103,000	-1.90	178.9	58.6	136,549	3,457	0.04%	307	-1,502	1,135
KT	32,450	-0.61	9.9	56.9	66,193	641	0.00%	1,535	-835	-702
현대엘리베이	49,850	-1.29	10.0	52.3	21,854	385	0.04%	639	2,150	-2,789

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터