

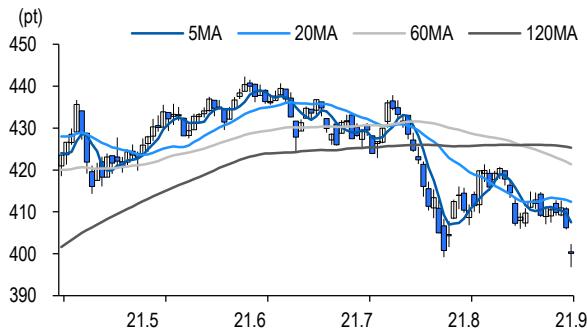


선물옵션시장 지표

2021.9.30

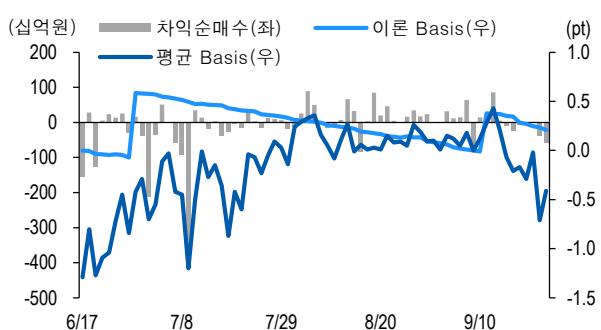
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	400.09	-1.50	-6.11	10,752.8	-
선물 12월물	399.15	-1.42	-5.75	36,778.6	270,270
선물 3월물	395.15	-1.62	-6.50	29.2	7,415
10월물(mini)	399.10	-1.36	-5.52	2,828.8	72,253
11월물(mini)	399.42	-1.40	-5.68	12.5	5,346



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.21	-0.41	-0.94	-0.15%
베이시스(mini)	-0.43	-0.56	-0.99	-0.03%
제1스프레드(SP)	-2.95	-3.81	-3.90	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.43	-0.97	-0.97	-0.14%



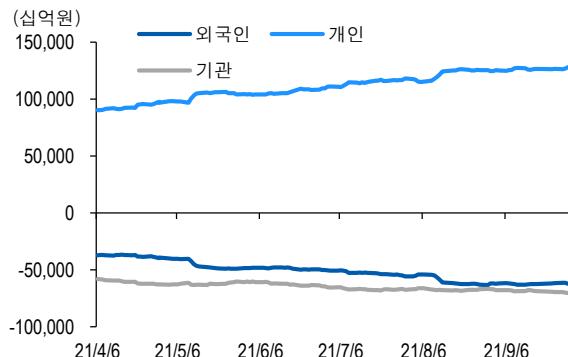
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-659.8	-48.4	-708.2	-10.4	-438.0	-29.6	-242.7	4.9	-3.4	25.9
개인	962.5	34.2	996.6	0.0	-1.6	-399.1	124.3	-7.1	8.2	-21.0
기관	-312.6	27.7	-284.9	-48.4	3.7	477.7	121.7	3.3	-5.5	-5.3
금융투자	-300.6	-238.8	-539.4	-54.6	-0.9	508.4	121.7	5.4	-4.9	24.6
투신	63.7	35.7	99.3	-1.5	8.9	-31.1	0.1	-0.4	0.3	-23.8
은행+보험+기타금융	-1.8	153.5	151.8	0.0	-0.1	16.2	-0.1	-1.8	-0.9	-1.2
연기금+국가지자체	-38.3	73.2	34.9	7.8	6.1	-15.8	0.0	0.0	0.0	-4.8
기타법인	10.0	-13.6	-3.5	0.0	0.5	-49.0	-3.2	-1.0	0.7	0.3

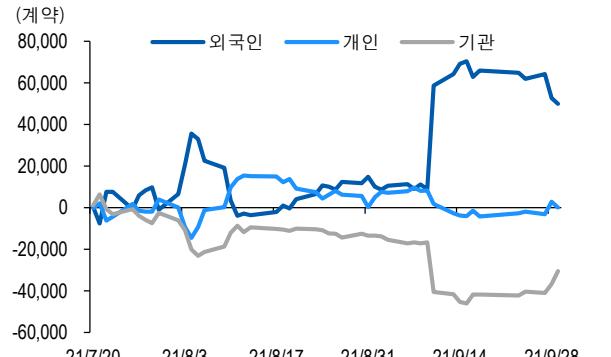
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



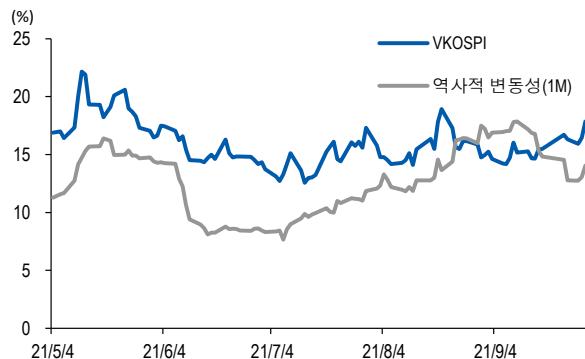
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	963,448	266.2	801,447	13.6%	지수옵션 전체	2,267,762	814.5	1,915,930
Put	1,304,314	548.2	1,114,483	18.1%	PCR(금액기준)	2.06	VKOSPI	17.87%(+1.42%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	412.5(K+3)	0.82	-1.04	101,569	14,815	6,894	13.4	407.5(K+1)
	410.0(K+2)	1.25	-1.42	126,108	20,472	7,611	13.5	405.0(K+0)
	407.5(K+1)	1.88	-1.79	74,359	11,353	5,486	13.7	402.5(K-1)
	405.0(K+0)	2.70	-2.22	74,348	8,425	6,232	14.0	400.0(K-2)
	402.5(K-1)	3.68	-2.68	35,504	4,202	3,622	14.1	397.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	407.5(K+1)	10.05	3.60	3,131	7,912	-131	17.0	
	405.0(K+0)	8.58	3.38	7,151	8,044	277	17.6	
	402.5(K-1)	7.09	2.89	7,506	6,572	206	17.6	
	400.0(K-2)	5.83	2.44	24,225	22,999	225	17.9	
	397.5(K-3)	4.77	2.11	19,397	12,366	-614	18.2	

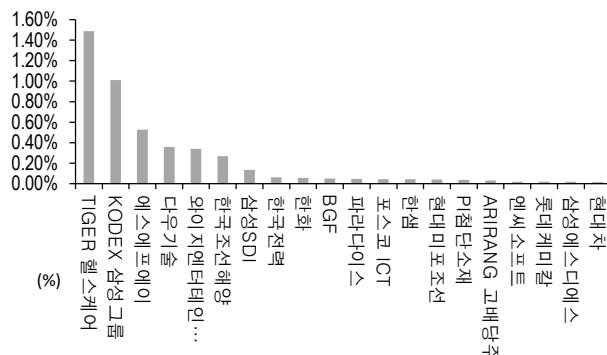
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	5,240,517	4,284.8	5,798,444	-13,135	4,677	-42,386	33,658	25.9	-21.0	-5.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	100,000	-2.91	568.4	89.6	143,370	6,821	-0.03%	4,423	-7,921	3,598
하나금융지주	45,450	-0.33	51.1	79.5	122,963	-11,956	-0.13%	231	-2,500	2,119
GS건설	42,400	-1.97	16.9	69.1	52,795	771	0.01%	-735	1,090	-355
삼성전자	74,200	-2.37	1,213.6	68.2	1,102,767	-23,142	-0.08%	763	-22,766	21,933
현대차	201,500	0.00	96.3	60.9	53,671	3,867	0.02%	6,751	318	-7,069
롯데케미칼	256,500	-2.84	31.5	60.9	8,436	229	0.02%	-594	631	-114
삼성SDI	708,000	-1.26	122.8	57.4	41,299	1,109	0.13%	359	704	-1,061
LG화학	770,000	-0.52	146.7	56.0	13,859	1,326	-0.12%	-1,463	1,959	-516
POSCO	330,000	-0.30	61.1	54.3	24,131	1,777	-0.10%	-1,864	2,528	-735
현대제철	47,150	-2.18	20.2	53.9	18,967	-764	-0.04%	-473	-14	497

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터