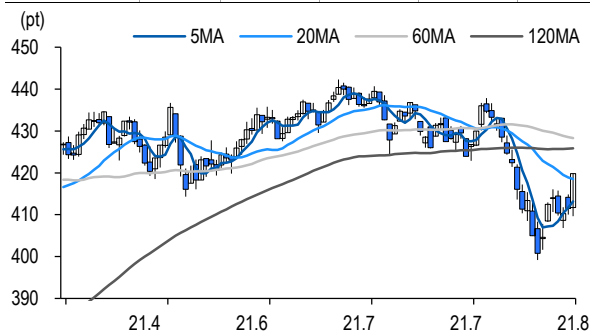


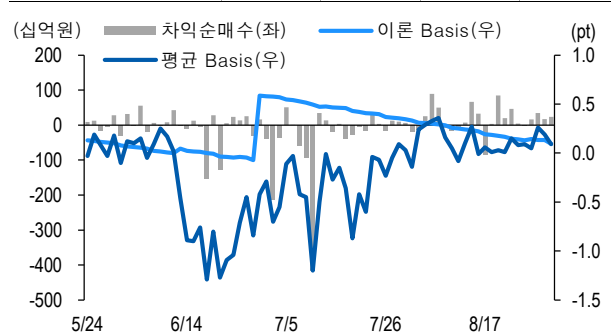
선물옵션시장 지표

2021.9.1

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	419.79	2.01	8.29	11,901.0	-
선물 9월물	419.50	1.85	7.60	38,819.6	261,696
선물 12월물	419.30	1.92	7.90	340.9	34,453
9월물(mini)	419.54	1.85	7.62	2,549.7	55,398
10월물(mini)	419.00	1.90	7.80	8.8	1,184



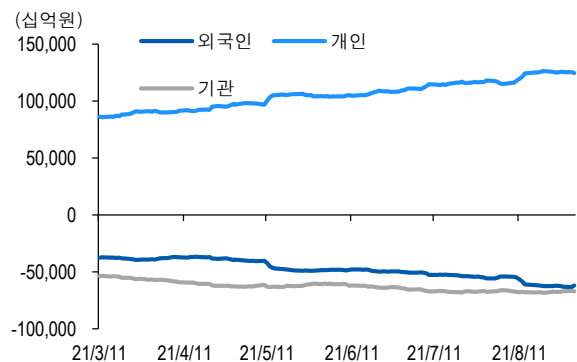
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.10	0.09	-0.29	0.00%
베이스(mini)	0.10	0.09	-0.25	0.00%
제1스프레드(SP)	0.36	-0.29	-0.25	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.10	-0.30	-0.30	-0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1,175.4	-44.3	1,131.1	-6.9	1,012.9	203.6	111.8	-2.6	2.2	-3.6
개인	-992.2	83.7	-908.5	0.0	-0.6	-475.3	-78.4	6.3	-4.7	-2.6
기관	-188.0	-41.3	-229.4	30.4	53.3	-67.8	-25.1	-4.8	3.8	5.9
금융투자	-214.6	-49.0	-263.6	24.5	80.7	-567.0	-24.9	-4.3	3.2	-14.4
투신	13.4	15.5	28.9	0.0	-10.3	502.1	-0.2	-0.6	0.3	-16.3
은행+보험+기타금융	-24.7	-5.6	-30.3	0.0	-22.4	0.3	0.0	0.1	0.4	-0.1
연기금+국가지자체	-3.4	-8.2	-11.5	5.9	-1.5	-3.1	0.0	0.0	0.0	36.7
기타법인	4.9	1.9	6.7	0.0	0.1	339.5	-8.4	1.1	-1.3	0.3

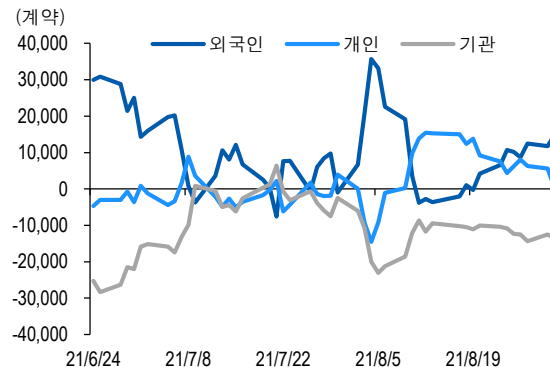
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



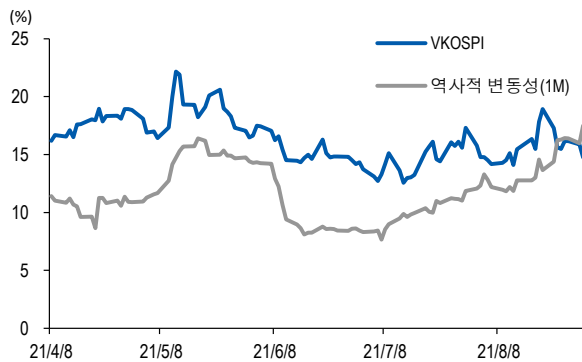
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,686,267	488.9	935,741	13.0%	지수옵션 전체	3,355,127	835.2	2,615,835
Put	1,668,860	346.3	1,680,094	16.2%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	14.76%(-1.12%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	3.56	2.29	222,613	24,474	532	13.0	Put	415.0(K+1)	2.16	-3.83	21,585	11,803	1,126	15.1
	417.5(K+2)	4.95	2.98	124,435	16,743	313	13.1		412.5(K+0)	1.51	-3.19	37,649	9,317	2,866	15.3
	415.0(K+1)	6.62	3.74	89,753	16,646	94	13.3		410.0(K-1)	1.06	-2.59	71,291	21,749	2,867	15.8
	412.5(K+0)	8.50	4.43	39,439	10,651	-482	13.4		407.5(K-2)	0.71	-2.08	88,688	12,346	3,108	16.0
	410.0(K-1)	10.55	5.05	13,960	12,799	357	13.4		405.0(K-3)	0.49	-1.62	148,714	23,337	4,213	16.5

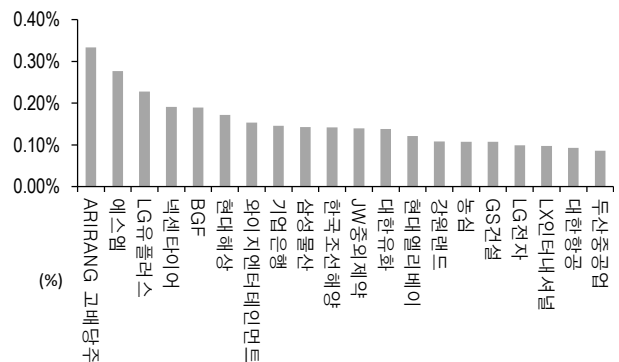
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,799,457	3,380.2	6,002,274	-32,985	-35,546	-21,705	57,387	-3.6	-2.6	5.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	76,500	2.41	1,131.2	68.4	1,157,522	-27,993	0.03%	-50,943	-828	51,821	3,742	45,100
SK 이노베이션	249,500	3.53	118.4	60.7	24,157	676	0.07%	174	-867	1,003	-2,234	1,177
코스맥스	130,500	-0.76	4.7	60.6	2,969	-1,651	-0.43%	-411	437	-26	1,181	110
하나금융지주	44,700	2.29	36.7	59.3	100,540	-3,612	-0.01%	-3,357	-3,703	7,087	3,313	1,420
SK 하이닉스	106,500	2.40	269.8	52.6	140,569	3,009	-0.02%	7,711	709	-8,545	-6,504	-500
현대제철	50,900	1.39	16.8	51.6	27,085	-744	0.00%	-536	-690	1,236	-853	2,492
삼성 SDI	789,000	3.68	156.0	51.5	30,507	-473	-0.01%	388	-520	84	-388	458
영진약품	5,400	-0.18	0.9	48.1	11,450	-1,402	0.06%	-1,495	-15	1,510	1,506	4
금호석유	195,500	2.36	24.6	44.9	11,702	-2,221	0.05%	1,194	2,565	-3,759	-2,399	-1,359
현대건설	55,500	3.54	29.9	44.8	34,944	9,646	0.03%	12,771	-2,260	-10,521	-5,573	-4,948

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터