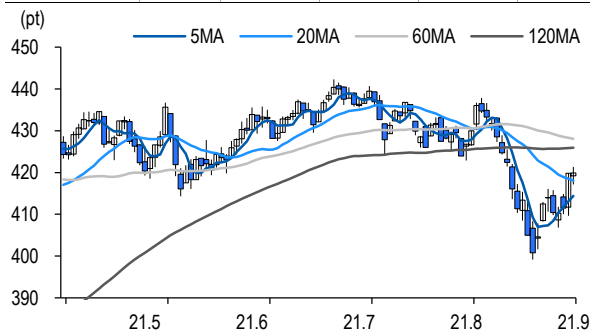


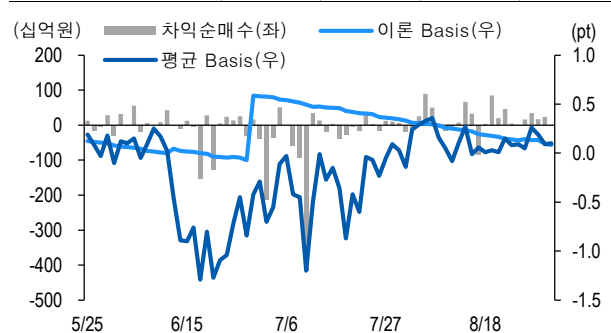
선물옵션시장 지표

2021.9.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	419.92	0.03	0.13	8,815.3	-
선물 9월물	419.80	0.07	0.30	33,018.4	255,878
선물 12월물	419.70	0.10	0.40	432.3	34,396
9월물(mini)	419.80	0.07	0.26	2,372.2	50,192
10월물(mini)	419.40	0.10	0.40	9.2	1,221



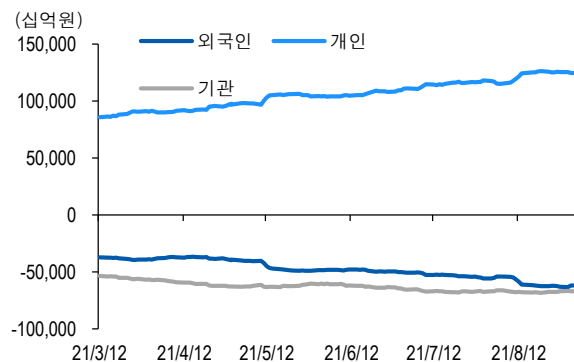
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.08	0.10	-0.12	0.00%
베이스(mini)	0.08	0.10	-0.12	0.00%
제1스프레드(SP)	0.36	-0.29	-0.25	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.08	-0.08	-0.08	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	118.6	-11.5	107.0	-0.9	217.6	-439.0	-58.9	-7.4	0.1	-18.4
개인	-103.3	113.1	9.8	0.0	-3.4	441.0	55.8	8.0	-2.4	1.1
기관	-31.6	-106.8	-138.4	0.8	-76.8	5.8	-1.1	-2.1	3.1	6.2
금융투자	-36.4	-164.8	-201.2	-1.3	-1.1	303.1	-1.3	-2.1	2.7	24.6
투신	32.0	19.7	51.7	0.0	-17.6	-265.6	0.3	-0.2	0.1	-16.0
은행+보험+기타금융	-60.7	37.8	-22.8	0.0	-56.3	-22.8	0.0	0.2	0.3	0.2
연기금+국가지자체	5.5	-4.0	1.5	2.1	-11.9	-9.0	-0.1	0.0	0.0	-2.5
기타법인	16.4	5.2	21.6	0.0	0.3	-7.9	4.1	1.5	-0.8	11.1

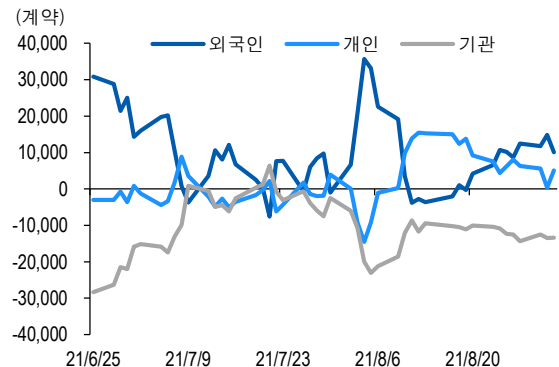
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



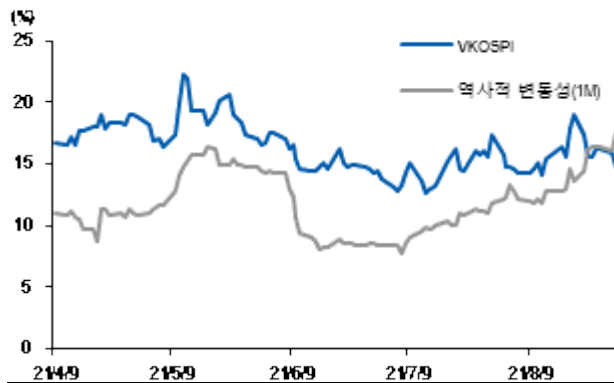
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,672,846	392.9	955,420	13.8%	지수옵션 전체	3,027,857	697.5	2,700,889
Put	1,355,011	304.5	1,745,469	15.3%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	14.96%(+0.20%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	1.07	0.03	191,507	30,964	2,676	13.8	Put	422.5(K+1)	5.24	-0.24	5,576	3,437	369	14.7
	425.0(K+2)	1.71	0.06	183,644	39,133	-5,107	13.9		420.0(K+0)	3.86	-0.22	22,334	11,450	2,677	14.7
	422.5(K+1)	2.57	0.11	102,242	25,819	-1,316	13.9		417.5(K-1)	2.77	-0.22	44,657	7,714	2,848	14.9
	420.0(K+0)	3.70	0.14	75,000	25,787	1,313	14.0		415.0(K-2)	1.95	-0.21	121,592	17,667	5,864	15.2
	417.5(K-1)	5.12	0.17	18,790	16,538	-205	14.2		412.5(K-3)	1.35	-0.16	124,068	12,476	3,159	15.5

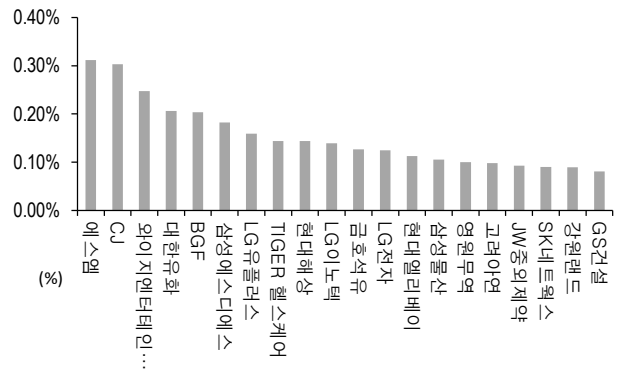
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,000,253	3,515.2	6,014,096	11,822	-33,799	11,770	8,447	-18.4	1.1	6.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	5,490	1.67	2.8	100.6	12,814	1,364	0.02%	3,644	-990	-2,656	-2,675	19
삼성전자	76,900	0.52	1,140.4	92.9	1,121,130	-36,392	0.01%	6,743	-24,945	2,190	13,182	-5,907
하나금융지주	45,050	0.78	29.0	82.0	96,284	-4,256	0.02%	-36	1,346	-1,310	-547	-758
삼성 SDI	789,000	0.00	116.8	77.5	30,895	388	0.04%	987	-196	-777	8	-765
현대차	215,000	1.18	137.9	74.9	61,462	-173	0.02%	-66	-3,003	3,082	3,085	-2
한미사이언스	73,700	0.41	11.9	72.0	12,901	5,871	-0.18%	4,367	-7,476	3,109	3,106	3
NAVER	444,000	1.14	207.2	71.5	60,751	-18,444	0.01%	810	-202	-607	424	-490
한국금융지주	95,100	0.00	9.4	69.8	35,413	-6,320	0.05%	1,024	388	-1,412	-1,217	-192
SK 이노베이션	245,000	-1.80	52.9	66.6	21,858	-2,299	0.01%	-554	-338	1,065	2,415	597
SK 하이닉스	107,500	0.94	315.9	62.7	135,914	-4,655	-0.04%	764	-4,367	3,787	4,735	4,410

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터