

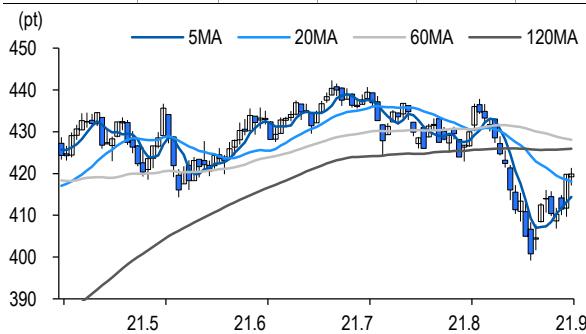


## 선물옵션시장 지표

2021.9.2

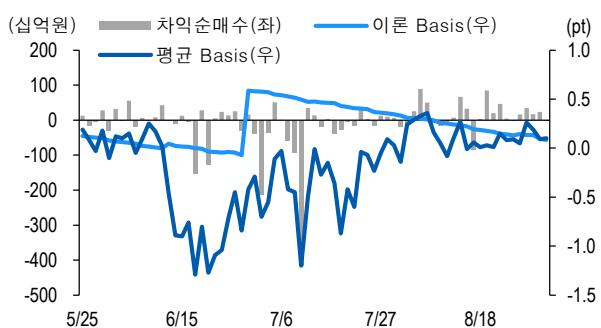
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	0.08	0.10	-0.12	0.00%
베이시스(mini)	0.08	0.10	-0.12	0.00%
제1스프레드(SP)	0.36	-0.29	-0.25	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.08	-0.08	-0.08	-0.04%



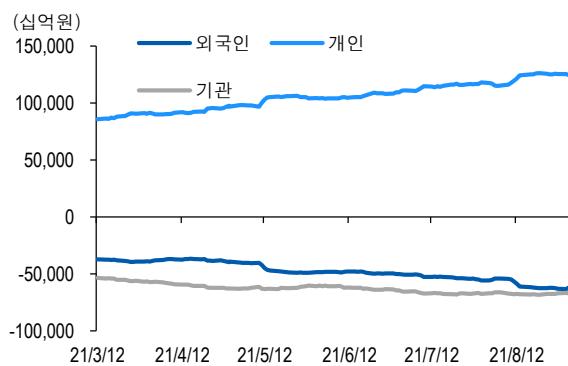
## 투자주체별 매매 동향

(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

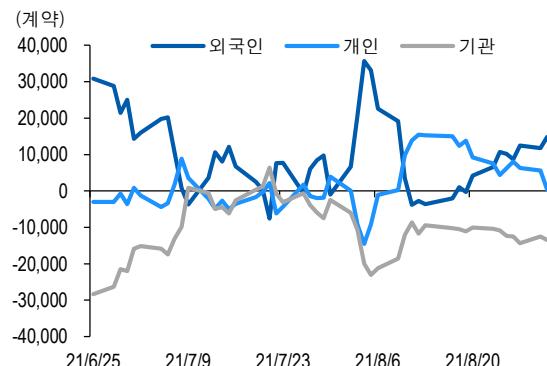
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



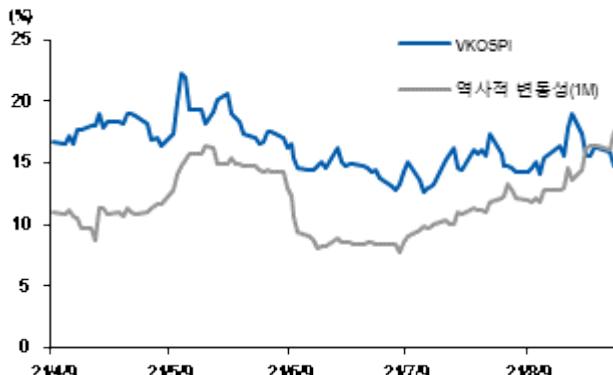
## 선물옵션시장 지표

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

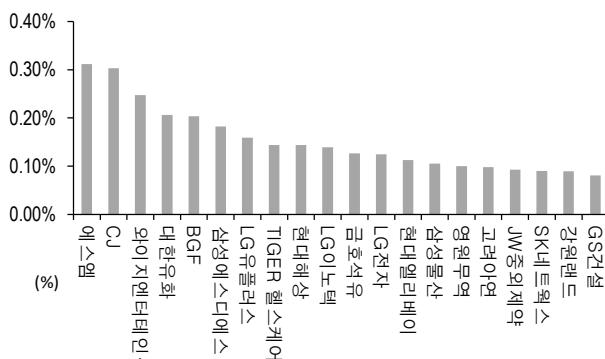
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영진약품	5,490	1.67	2.8	100.6	12,814	1,364	0.02%	3,644	-990	-2,656
삼성전자	76,900	0.52	1,140.4	92.9	1,121,130	-36,392	0.01%	6,743	-24,945	2,190
하나금융지주	45,050	0.78	29.0	82.0	96,284	-4,256	0.02%	-36	1,346	-1,310
삼성 SDI	789,000	0.00	116.8	77.5	30,895	388	0.04%	987	-196	-777
현대차	215,000	1.18	137.9	74.9	61,462	-173	0.02%	-66	-3,003	3,082
한미사이언스	73,700	0.41	11.9	72.0	12,901	5,871	-0.18%	4,367	-7,476	3,109
NAVER	444,000	1.14	207.2	71.5	60,751	-18,444	0.01%	810	-202	-607
한국금융지주	95,100	0.00	9.4	69.8	35,413	-6,320	0.05%	1,024	388	-1,412
SK 이노베이션	245,000	-1.80	52.9	66.6	21,858	-2,299	0.01%	-554	-338	1,065
SK 하이닉스	107,500	0.94	315.9	62.7	135,914	-4,655	-0.04%	764	-4,367	3,787

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터