

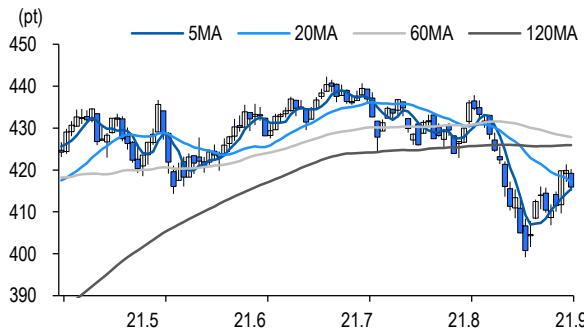


선물옵션시장 지표

2021.9.3

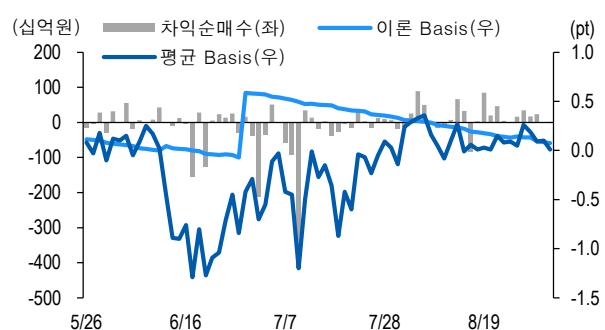
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	415.89	-0.96	-4.03	8,280.2	-
선물 9월물	416.60	-0.76	-3.20	30,680.7	250,344
선물 12월물	416.10	-0.86	-3.60	432.9	35,615
9월물(mini)	416.54	-0.78	-3.26	1,967.3	49,954
10월물(mini)	415.72	-0.88	-3.68	12.6	1,395



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.07	0.01	0.71	-0.02%
베이시스(mini)	0.07	0.01	0.65	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.36	-0.27	-0.25	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	0.68	0.68	0.15%



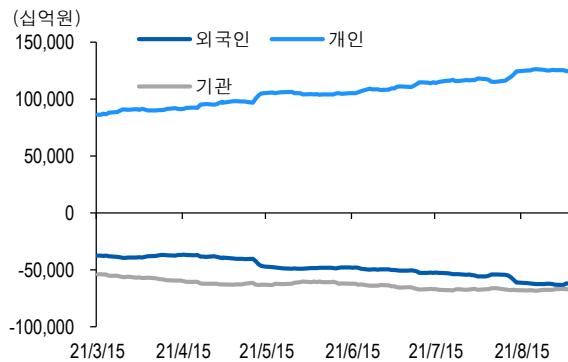
투자주체별 매매 동향

(십억원)

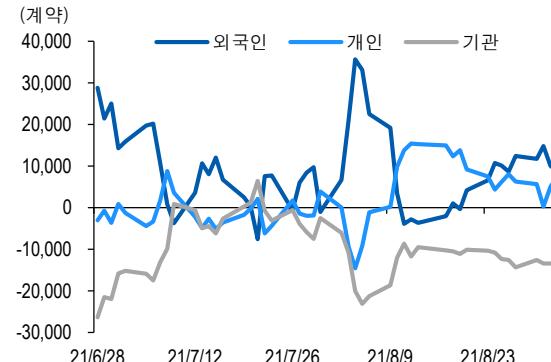
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-380.4	16.1	-364.3	0.0	-100.2	-46.7	-87.5	0.7	2.5	2.5
개인	941.8	52.6	994.4	0.0	-1.2	183.2	81.6	-1.6	0.2	16.8
기관	-574.9	-64.7	-639.6	1.5	-161.4	-24.6	-6.5	1.4	-3.3	-16.6
금융투자	-359.2	-82.0	-441.2	-2.5	4.7	329.9	-6.3	1.3	-3.3	19.4
투신	-47.6	-12.9	-60.5	0.0	-24.1	-380.6	-0.1	0.0	0.0	-25.5
은행+보험+기타금융	-49.7	37.0	-12.7	0.0	-44.6	38.7	0.0	0.1	0.0	-0.3
연기금+국가지자체	-104.1	-2.6	-106.6	4.0	-101.0	-12.6	-0.1	0.0	0.0	-10.2
기타법인	13.5	-4.0	9.5	0.0	0.0	-111.9	12.4	-0.5	0.6	-2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



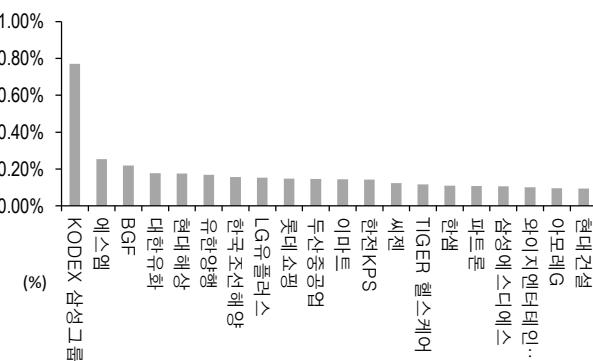
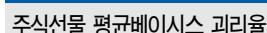
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정	
Call	1,206,613	266.4	989,311		14.3%	지수옵션 전체		2,596,356	654.5	2,796,781	
Put	1,389,743	388.1	1,807,470		13.6%	PCR(금액기준)		1.46	VKOSPI	15.25%(+0.29%p)	
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)
	427.5(K+3)	0.38	-0.69	183,562	33,291	2,327	14.0		422.5(K+1)	7.15	1.91
	425.0(K+2)	0.70	-1.01	166,693	40,702	1,569	14.2		420.0(K+0)	5.39	1.53
	422.5(K+1)	1.21	-1.36	112,970	27,610	1,791	14.4		417.5(K-1)	3.95	1.18
	420.0(K+0)	1.96	-1.74	104,180	27,058	1,271	14.7		415.0(K-2)	2.80	0.85
	417.5(K-1)	3.00	-2.12	48,542	18,360	1,822	15.1		412.5(K-3)	1.93	0.58

자료: KRX, 유안티증권 리서치센트



자료: KRX, 유안티증권 리서치센-



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	3,678,748	3,201.8	6,066,826	52,730	-26,351	2,987	23,636	2.5	16.8	-16.6		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	76,300	-0.78	947.0	81.7	1,094,380	-26,750	0.03%	4,471	3,160	-7,633	-10,726	-110
한미사이언스	73,600	-0.14	7.6	79.7	10,409	-2,492	-0.02%	-2,639	2,882	-243	-237	-6
GS건설	44,700	0.11	18.7	78.2	45,785	-8,838	-0.01%	595	523	-1,118	3,926	4,633
SK 하이닉스	106,000	-1.40	224.6	77.4	141,540	5,626	-0.06%	-1,811	4,698	-2,811	4,786	-5,390
롯데케미칼	247,500	0.41	15.8	74.2	7,896	-802	0.02%	281	-746	416	48	396
현대건설	54,400	0.37	16.7	67.8	35,992	4,028	0.09%	4,256	141	-4,397	-5,962	1,565
POSCO	343,000	1.33	110.6	64.7	20,156	488	0.06%	-1,862	-482	2,382	630	378
SK 텔레콤	309,000	-1.12	54.1	63.8	19,034	-1,126	0.01%	-767	1,229	-462	-326	772
KT	33,050	-1.49	15.0	61.6	59,904	121	0.03%	-4,783	4,416	362	-2,750	3,112
하나금융지주	44,700	-0.78	23.1	60.4	95,780	-504	0.02%	-23	2,277	-2,254	-1,536	-696

자료: KBX 유아티즈권 리서치센터