

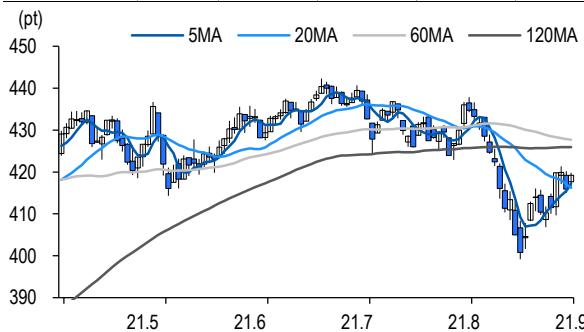


선물옵션시장 지표

2021.9.6

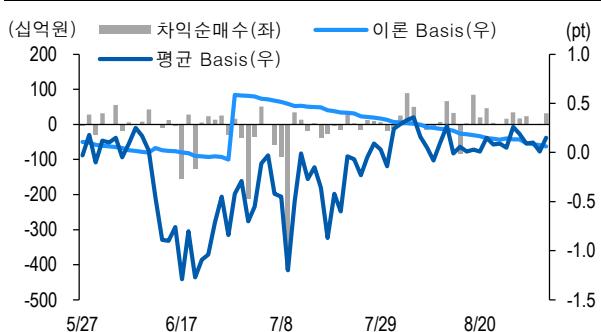
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	419.22	0.80	3.33	8,888.9	-
선물 9월물	419.15	0.61	2.55	28,818.4	245,673
선물 12월물	418.90	0.67	2.80	450.7	43,280
9월물(mini)	419.18	0.62	2.64	1,881.2	49,862
10월물(mini)	418.60	0.69	2.88	12.7	1,558



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.06	0.15	-0.07	0.02%
베이시스(mini)	0.06	0.15	-0.04	0.02%
제1스프레드(SP)	0.37	-0.29	-0.30	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.06	-0.07	-0.07	-0.03%



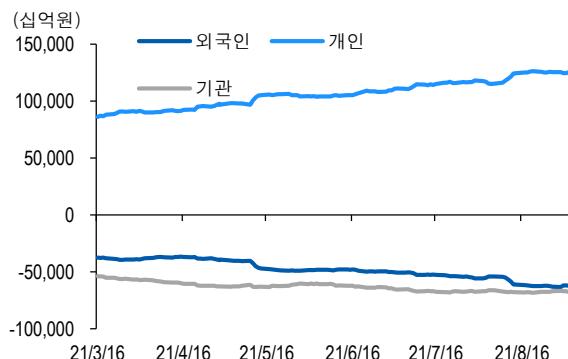
투자주체별 매매 동향

(십억원)

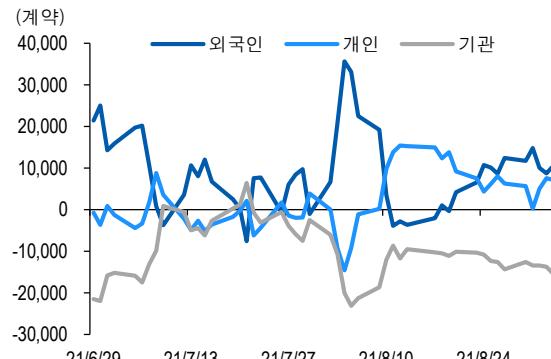
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	580.6	-47.7	532.8	37.8	310.4	36.3	156.7	-0.7	1.0	-7.7
개인	-468.8	105.8	-363.0	0.0	-4.3	100.1	-149.9	1.9	-1.1	9.6
기관	-76.7	-60.4	-137.1	-5.6	-125.3	-190.0	3.0	-1.2	1.1	-0.9
금융투자	-28.8	-94.6	-123.5	0.5	4.4	-355.4	2.9	-0.5	0.7	-4.9
투신	20.2	-0.3	20.0	0.0	0.3	230.3	0.0	-0.8	0.1	3.6
은행+보험+기타금융	-42.7	33.5	-9.2	0.0	-44.5	-74.1	0.0	0.1	0.3	-0.1
연기금+국가지자체	-81.0	0.4	-80.6	-10.3	-86.6	9.3	0.1	0.0	0.0	0.4
기타법인	-35.1	2.3	-32.8	0.0	0.0	53.6	-9.8	0.0	-1.0	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



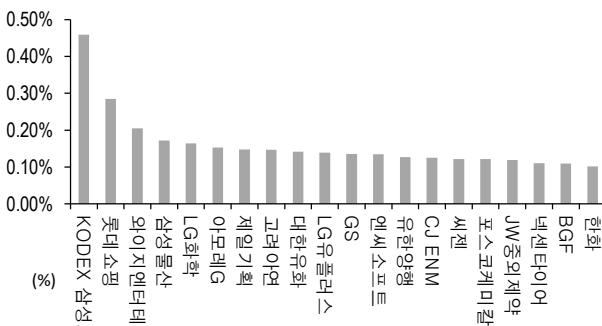
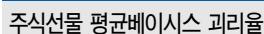
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	2,091,722	466.1	1,030,120	12.4%	지수옵션 전체	3,884,911	781.2	2,896,381							
Put	1,793,189	315.1	1,866,261	14.7%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	14.62%(-0.63%)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	1.56	0.35	233,903	27,084	-526	12.4	Put	417.5(K+1)	2.31	-1.64	69,604	12,512	2,995	13.5
	420.0(K+2)	2.57	0.61	191,882	26,888	-170	12.6		415.0(K+0)	1.49	-1.31	142,197	21,574	3,893	13.8
	417.5(K+1)	3.94	0.94	47,722	19,100	740	12.8		412.5(K-1)	0.95	-0.98	197,649	20,115	4,468	14.3
	415.0(K+0)	5.64	1.27	13,715	17,473	427	13.1		410.0(K-2)	0.58	-0.73	310,643	35,421	5,918	14.7
	412.5(K-1)	7.57	1.54	3,593	10,184	-423	13.2		407.5(K-3)	0.35	-0.50	208,821	27,459	7,928	15.2

자료: KRX, 유안티증권 리서치센-



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	3,056,142	2,900.0	6,073,155	6,329	-31,701	14,735	17,343	-7.7	9.6	-0.9		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균고리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	76,500	0.26	688.7	75.7	1,067,774	-26,606	-0.01%	-26,763	22,740	4,029	-15,226	19,554
현대위아	90,300	-0.11	10.2	71.4	9,764	-2,523	-0.08%	-710	185	515	1,819	1,457
KT	32,950	-0.30	12.1	68.4	63,630	3,726	-0.05%	-5,991	6,442	-451	-281	-170
현대건설	55,300	1.65	18.3	67.1	36,574	582	0.02%	-389	-2,040	2,529	620	1,728
현대차	215,000	1.42	86.2	66.5	57,362	-2,601	0.06%	1,761	-629	-1,124	-1,241	-316
삼성전기	184,000	0.55	36.9	62.6	17,269	-4,485	-0.22%	2,460	-386	-2,074	2,587	50
하나금융지주	44,600	-0.22	19.2	62.1	82,622	-13,158	0.05%	1,595	-77	-1,518	-734	-784
삼성 SDI	761,000	1.60	93.3	58.7	30,382	-381	0.04%	418	-170	-248	-312	-345
POSCO	348,500	1.60	82.4	57.3	21,380	1,224	-0.01%	1,830	-1,339	-488	-641	-182
SK 텔레콤	306,000	-0.97	43.9	53.8	19,335	301	0.05%	-864	1,522	-658	221	-879

자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터