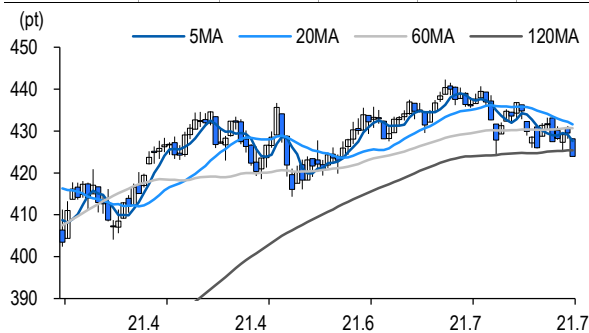


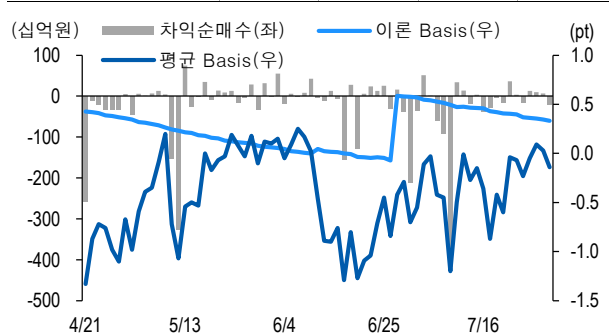
선물옵션시장 지표

2021.8.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	423.91	-1.30	-5.58	8,681.0	-
선물 9월물	424.40	-1.16	-5.00	25,305.3	257,005
선물 12월물	423.70	-1.22	-5.25	26.8	29,089
8월물(mini)	424.38	-1.16	-5.00	2,448.5	60,585
9월물(mini)	424.12	-1.23	-5.54	10.2	14,018



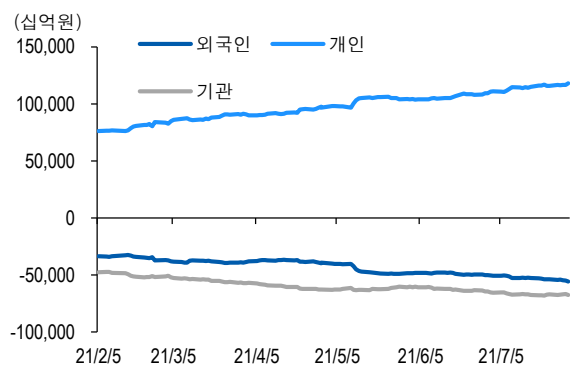
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.33	-0.14	0.49	-0.11%
베이스(mini)	0.11	-0.13	0.47	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.60	-0.50	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	0.34	0.34	0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-712.0	-60.2	-772.2	-22.5	-665.7	-1,374.7	230.7	-0.9	4.0	-8.7
개인	1,255.2	127.1	1,382.3	0.0	1.4	539.3	70.9	-0.3	0.3	-9.3
기관	-571.4	-69.8	-641.1	2.7	-77.8	836.7	-308.7	1.5	-4.2	20.1
금융투자	-288.1	-166.8	-455.0	9.4	-1.6	1,159.1	-308.6	1.5	-2.9	52.0
투신	-86.5	16.3	-70.2	0.0	-48.5	-309.6	0.0	0.0	0.0	-49.6
은행+보험+기타금융	-22.1	90.0	67.8	0.0	2.8	-18.3	0.0	0.0	-1.2	0.1
연기금+국가자재	-171.3	-3.2	-174.6	-6.7	-61.8	5.4	-0.1	0.0	0.0	17.6
기타법인	28.2	2.8	31.0	0.0	-0.5	-1.3	7.1	-0.3	-0.1	-2.1

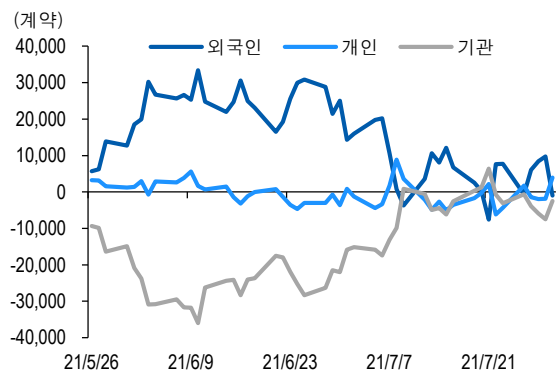
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	625,230	170.2	749,285	13.4%	지수옵션 전체	1,574,915	498.5	2,077,573
Put	949,685	328.3	1,328,288	14.6%	PCR(금액기준)	1.93	VKOSPI	17.30%(+1.72%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	0.60	-0.69	68,349	21,266	4,163	13.1	Put	432.5(K+1)	10.00	3.97	1,507	4,890	19	13.6
	435.0(K+2)	0.98	-0.97	85,780	19,463	1,976	13.4		430.0(K+0)	7.97	3.22	6,263	12,436	-493	13.0
	432.5(K+1)	1.50	-1.37	73,173	14,217	2,221	13.5		427.5(K-1)	6.42	2.74	10,900	11,246	104	13.4
	430.0(K+0)	2.22	-1.84	50,314	14,995	3,003	13.8		425.0(K-2)	5.12	2.26	29,667	18,337	1,054	13.9
	427.5(K-1)	3.23	-2.27	20,930	7,578	1,975	14.3		422.5(K-3)	4.13	1.92	29,716	9,133	669	14.7

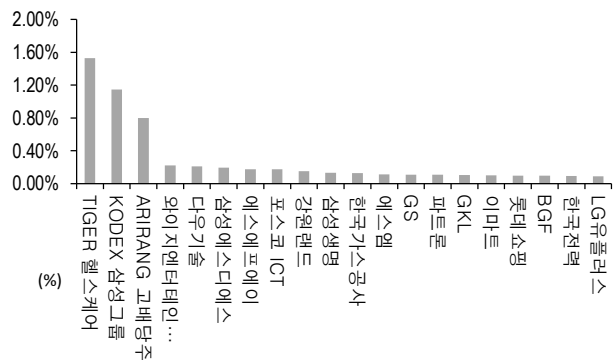
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,132,497	2,808.3	6,518,985	38,871	-12,830	5,834	11,343	-8.7	-9.3	20.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	43,350	-3.02	61.3	113.9	137,244	-17,245	0.00%	3,520	12,916	-16,886	751	5,435
엔씨소프트	825,000	-1.90	46.9	71.0	6,774	-163	-0.07%	-488	310	178	25	160
호텔신라	93,500	-1.06	17.2	64.1	22,361	420	0.01%	408	-217	-191	330	-521
KT	33,800	0.15	25.6	62.9	77,297	523	0.02%	5,207	-3,853	-1,360	-693	-667
LG 이노텍	227,000	-1.30	27.8	60.3	16,081	895	-0.02%	522	266	-918	-887	401
POSCO	366,000	2.09	136.9	57.2	18,902	1,747	0.01%	1,473	-243	-1,196	-574	-1,458
삼성 SDI	740,000	-3.01	128.5	55.5	41,648	-377	-0.08%	168	292	-411	1,459	-375
LG 화학	839,000	0.60	137.5	51.3	15,556	-472	-0.09%	557	-491	-46	-180	-117
현대건설	54,900	-0.72	12.0	51.2	24,419	1,585	0.07%	2,159	588	-2,566	-666	-1,900
삼성생명	75,500	-1.31	10.5	50.5	28,973	786	0.13%	815	1,130	-2,036	-93	-1,936

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터