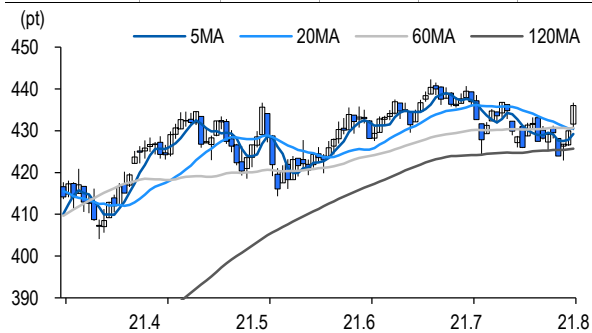


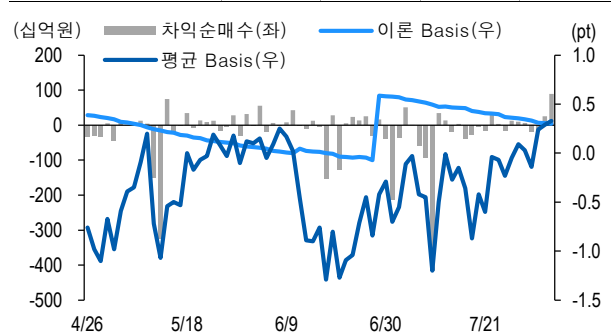
선물옵션시장 지표

2021.8.5

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.05	1.41	6.07	9,373.2	-
선물 9월물	436.20	1.37	5.90	27,771.2	257,081
선물 12월물	435.75	1.42	6.10	95.9	29,419
8월물(mini)	436.14	1.39	5.96	2,255.7	86,869
9월물(mini)	436.50	1.44	6.30	15.2	20,376



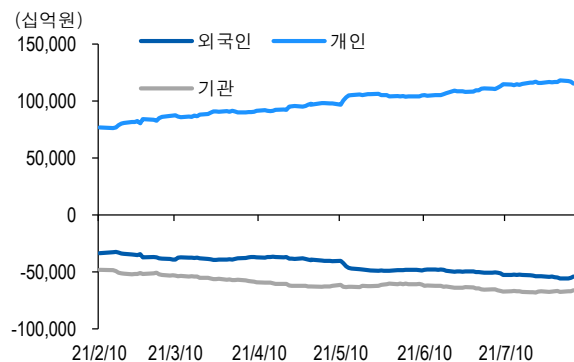
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.30	0.33	0.15	0.01%
베이스(mini)	0.07	0.22	0.09	0.04%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.58	-0.45	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.07	0.21	0.21	0.03%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	907.2	5.9	913.1	42.5	539.2	1,378.8	235.5	-27.0	-1.2	4.6
개인	-1,776.2	12.9	-1,763.2	0.0	1.4	-415.1	-160.2	34.7	-3.4	-0.3
기관	873.4	-19.4	854.1	47.0	-28.1	-961.9	-46.3	-7.3	5.9	-2.5
금융투자	775.2	59.4	834.6	33.1	16.7	-674.5	-43.7	-7.2	5.0	-50.9
투신	14.5	-14.3	0.3	0.0	-34.4	-265.8	0.0	0.0	-0.1	47.1
은행+보험+기타금융	-6.7	-50.9	-57.6	0.0	-5.6	-7.0	-2.7	0.0	1.0	-0.2
연기금+국가지자체	-14.9	-7.0	-21.9	4.0	-33.0	-14.7	0.2	0.0	0.0	1.5
기타법인	-4.5	0.6	-3.9	0.0	-0.1	-1.8	-29.1	-0.4	-1.3	-1.7

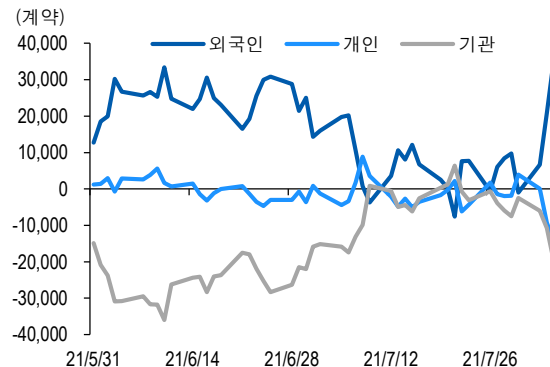
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



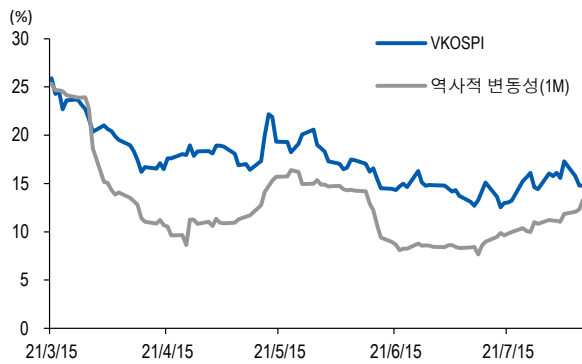
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,628,187	512.0	881,207	12.8%	지수옵션 전체	3,001,598	763.6	2,447,867
Put	1,373,411	251.6	1,566,660	15.0%	PCR(금액기준)	0.49	VKOSPI	14.77%(-0.01%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	2.79	2.02	219,124	22,893	-3,947	12.6	Put	432.5(K+1)	2.11	-2.51	41,956	9,729	4,435	13.4
	435.0(K+2)	4.09	2.71	138,522	23,469	-1,802	12.8		430.0(K+0)	1.50	-1.90	84,201	23,147	9,569	14.0
	432.5(K+1)	5.79	3.52	65,338	16,655	1,281	13.6		427.5(K-1)	1.08	-1.33	92,657	18,148	5,748	14.8
	430.0(K+0)	7.76	4.27	59,166	33,194	13,978	14.6		425.0(K-2)	0.70	-1.05	153,695	25,229	4,489	15.0
	427.5(K-1)	9.79	4.78	8,184	9,861	-525	15.2		422.5(K-3)	0.50	-0.73	136,701	20,131	8,898	15.7

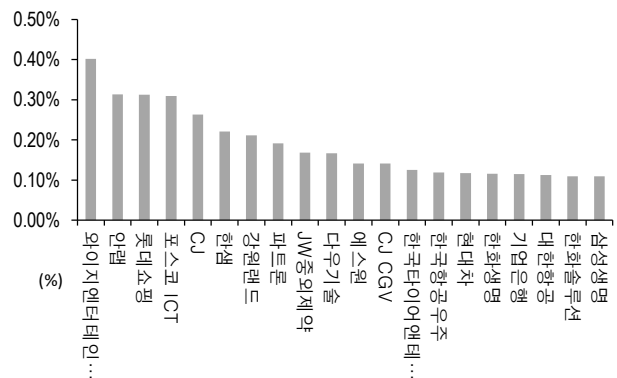
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,586,563	4,192.1	6,807,975	86,726	116,013	-74,353	-39,676	4.6	-0.3	-2.5		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 텔레콤	307,500	0.49	61.1	143.0	17,548	721	-0.02%	-1,143	557	586	388	198
하나금융지주	44,000	2.09	43.4	99.5	95,957	-28,436	-0.02%	2,873	-13,412	10,576	6,112	8,610
삼성 SDI	744,000	-0.67	169.2	93.0	38,835	-875	0.06%	97	155	-161	360	81
엔씨소프트	812,000	0.00	43.3	86.4	7,049	7	-0.03%	8	-76	75	110	296
NAVER	434,000	1.40	186.8	79.8	81,566	-636	0.02%	-343	2,094	-1,922	-1,207	176
SK 하이닉스	121,500	0.83	377.7	74.7	167,448	8,337	-0.04%	-8,132	5,140	2,874	3,079	-171
호텔신라	94,300	1.62	26.5	71.6	21,511	730	0.01%	1,873	469	-2,352	-2,197	-375
LG 화학	856,000	0.35	111.0	71.4	16,009	251	-0.02%	315	80	-394	366	-695
LG 이노텍	226,000	0.67	21.8	67.1	15,975	136	0.08%	-673	303	372	-550	208
롯데케미칼	270,000	-0.37	15.4	63.8	11,568	317	0.08%	-152	251	-99	-65	-135

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터