

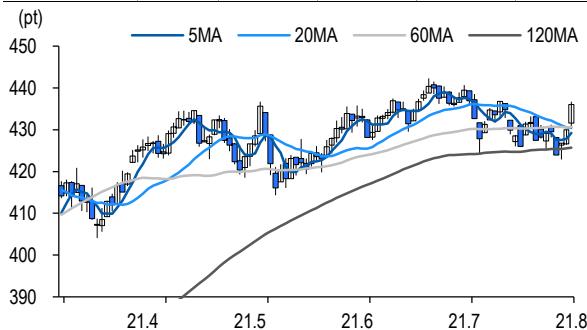


## 선물옵션시장 지표

2021.8.5

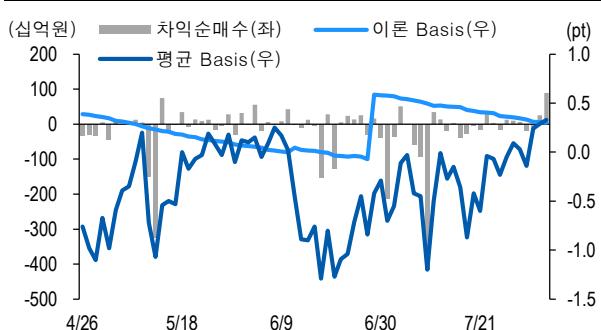
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	0.30	0.33	0.15	0.01%
베이시스(mini)	0.07	0.22	0.09	0.04%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.58	-0.45	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	0.21	0.21	0.03%



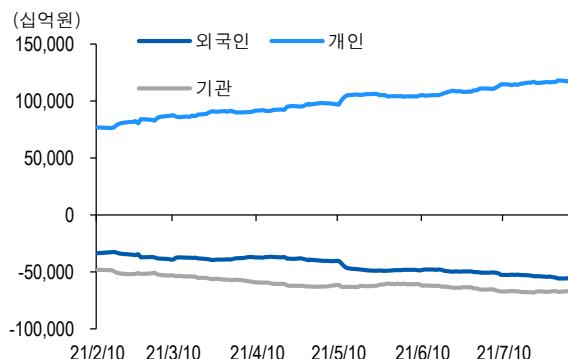
## 투자주체별 매매 동향

(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

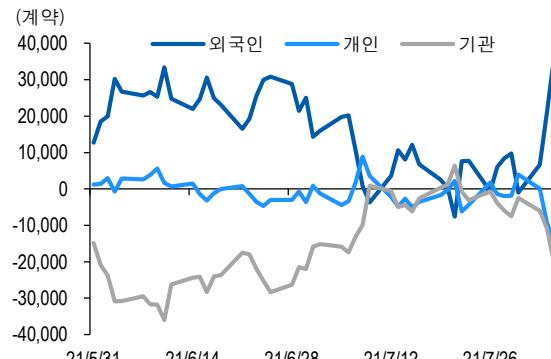
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이





## 선물옵션시장 지표

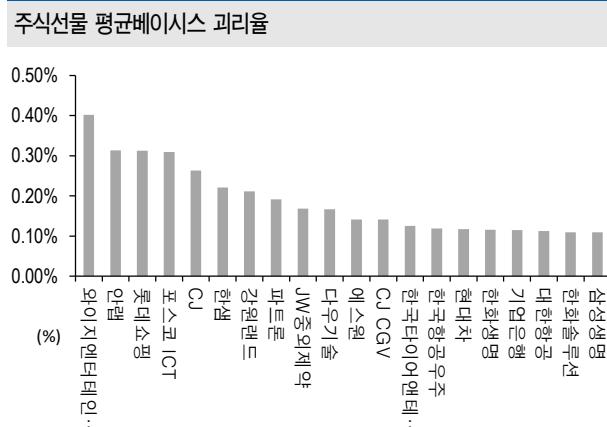
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,628,187	512.0	881,207	12.8%	지수옵션 전체	3,001,598	763.6	2,447,867							
Put	1,373,411	251.6	1,566,660	15.0%	PCR(금액기준)	0.49	VKOSPI	14.77%(-0.01%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감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



---

자료: KRX, 유안타증권 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	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: KBX 유티즌워 리서치센