

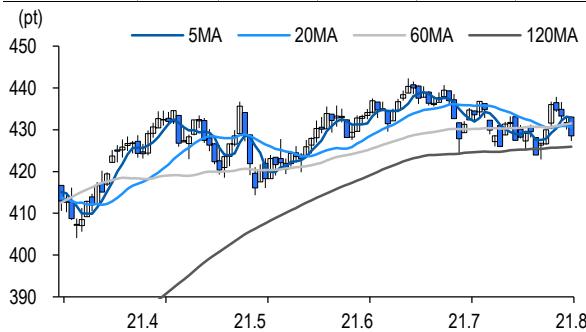


선물옵션시장 지표

2021.8.11

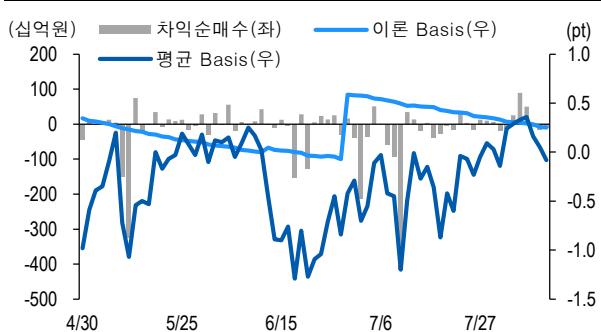
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	428.56	-0.72	-3.09	13,831.4	-
선물 9월물	429.00	-0.69	-3.00	25,111.4	263,629
선물 12월물	428.35	-0.72	-3.10	84.0	30,493
8월물(mini)	429.14	-0.65	-2.82	2,209.1	74,690
9월물(mini)	428.98	-0.70	-3.02	35.9	18,857



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.25	-0.08	0.44	-0.08%
베이시스(mini)	0.02	0.04	0.58	0.01%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.44	-0.45	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.02	0.49	0.49	0.11%

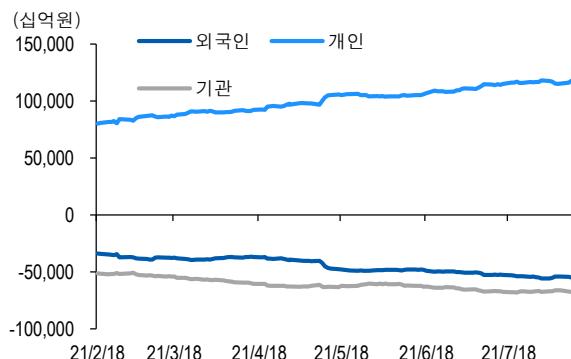


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-637.8	-18.5	-656.3	0.0	-286.0	-1,715.9	32.4	1.5	0.3	100.6
개인	1,543.0	40.6	1,583.5	0.0	-2.5	911.6	117.5	-0.7	2.0	-12.0
기관	-383.4	-18.0	-401.4	-11.5	-64.7	864.2	-160.7	0.4	-2.9	-89.1
금융투자	-141.3	-54.4	-195.7	-0.7	12.6	801.0	-160.2	0.8	-2.9	-70.3
투신	-59.5	5.0	-54.5	0.0	-47.1	142.5	0.0	-0.4	0.0	-46.0
은행+보험+기타금융	-45.3	34.0	-11.4	0.0	-9.1	-15.9	-0.3	0.0	0.0	-2.4
연기금+국가지자체	-45.6	-1.4	-47.0	-10.9	-7.9	-63.3	-0.2	0.0	0.0	29.6
기타법인	-521.7	-4.0	-525.8	0.0	-0.1	-60.0	10.8	-1.3	0.7	0.5

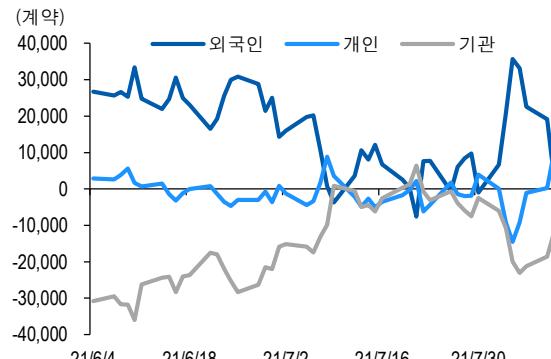
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



지수옵션 시장동향

거래량		거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,778,126	275.4	1,028,318	13.3%	지수옵션 전체	3,999,670	745.8	2,746,041
Put	2,221,544	470.4	1,717,723	12.1%	PCR(금액기준)	1.71	VKOSPI	14.52%(+0.24%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	0.04	-0.16	210,625	46,913	4,518	14.1	Put	435.0(K+1)	6.18	2.14	15,325	11,928	-1,176	0.7
	437.5(K+2)	0.09	-0.34	298,855	39,701	7,817	13.2		432.5(K+0)	4.08	1.54	45,039	14,650	-260	8.1
	435.0(K+1)	0.23	-0.75	334,876	43,995	14,777	12.7		430.0(K-1)	2.40	0.90	142,555	22,919	-34	10.3
	432.5(K+0)	0.63	-1.34	314,142	27,479	8,633	12.9		427.5(K-2)	1.34	0.50	321,550	22,413	-3,778	11.8
	430.0(K-1)	1.43	-1.99	198,010	25,841	6,852	13.3		425.0(K-3)	0.65	0.20	440,760	35,244	-2,775	12.6

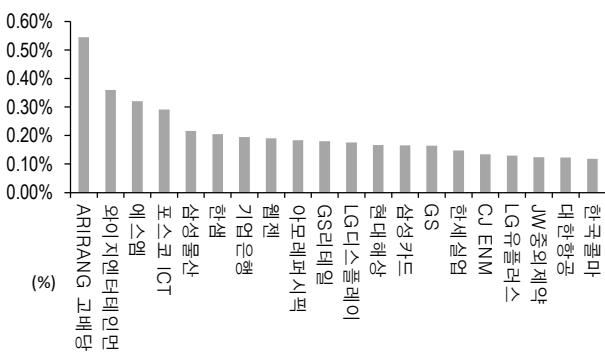
자료: KRX, 유안타증권 리서치센-

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안티증권 리서치센-

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KBY 유티즌워리리서치센터

주신서물시작 독학(서현배율 삼위 10종모)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,121,740	4,749.9	7,281,120	208,330	120,789	9,066	-133,004	100.6	-12.0	-89.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	446,500	-0.33	252.3	122.4	67,223	-1,639	0.01%	148	-1,620	1,472	765	707
하나금융지주	44,050	-0.79	39.7	112.5	60,200	-13,273	-0.01%	-4,102	1,099	2,969	1,456	5,716
엔씨소프트	813,000	-0.85	33.0	84.0	6,122	-294	-0.01%	-185	177	8	47	67
SK 텔레콤	302,500	-0.17	30.4	83.1	10,752	-5,668	0.02%	625	60	-685	-1,241	556
삼성전자	80,500	-1.47	1,342.8	81.9	717,430	-307,430	0.06%	103,424	-4,931	-98,181	-51,624	-4,597
KT	33,400	-0.45	20.2	77.1	49,188	-14,018	0.08%	-7,417	7,363	47	678	-631
LG 전자	157,000	-2.48	102.8	76.1	43,614	-8,065	-0.07%	-4,528	1,329	3,199	2,078	3,360
아모레퍼시픽	229,000	1.33	17.1	72.0	13,112	-2,109	0.18%	-25	201	-306	-1,294	-1,000
삼성전기	186,500	-2.86	84.8	70.6	23,801	-11,778	-0.12%	-899	640	257	2,803	5,007
LG 디스플레이	22,200	1.37	27.0	69.5	311,257	-110,804	0.18%	5,412	-368	-6,361	-524	-4,723

자료: KBX 유통기획 리서치센터