

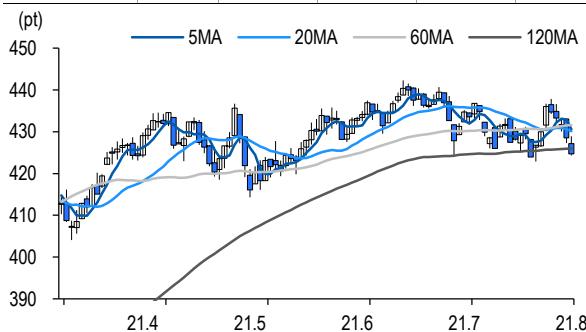


선물옵션시장 지표

2021.8.12

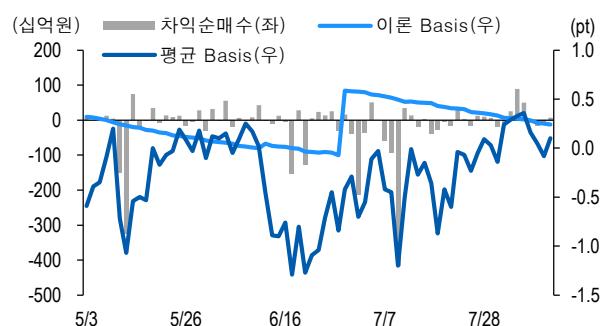
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.74	-0.89	-3.82	12,835.2	-
선물 9월물	425.00	-0.93	-4.00	25,890.7	265,848
선물 12월물	424.80	-0.83	-3.55	79.7	31,055
8월물(mini)	424.92	-0.98	-4.22	2,086.2	74,456
9월물(mini)	425.00	-0.93	-3.98	63.2	25,254



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.24	0.10	0.26	-0.03%
베이시스(mini)	0.01	0.09	0.18	0.02%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.43	-0.50	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.01	0.19	0.19	0.04%



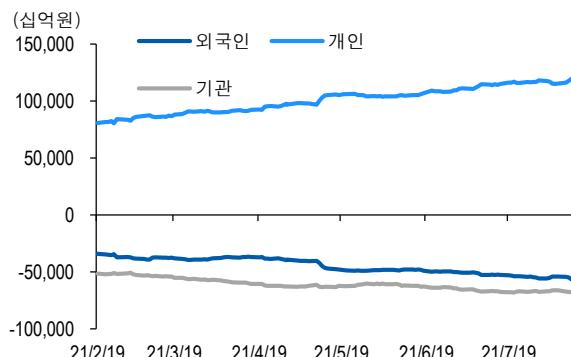
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,613.7	-28.1	-1,641.8	0.0	-759.2	-689.0	-93.0	-1.7	-1.8	78.7
개인	1,784.9	14.9	1,799.8	0.0	5.1	409.3	33.5	-0.7	5.5	-96.8
기관	-191.5	22.9	-168.6	7.0	-82.8	315.0	50.0	2.9	-4.3	24.8
금융투자	273.9	-53.2	220.7	0.5	2.4	80.3	49.6	3.4	-4.4	-3.6
투신	-87.9	42.3	-45.5	0.0	-29.1	221.7	0.0	-0.5	0.1	9.9
은행+보험+기타금융	-47.3	30.7	-16.6	0.0	-18.7	2.1	0.2	0.0	-0.1	0.8
연기금+국가지자체	-169.0	0.5	-168.5	6.5	-27.6	10.9	0.2	0.0	0.0	17.6
기타법인	20.3	-9.8	10.5	0.0	0.3	-35.3	9.6	-0.4	0.6	-6.7

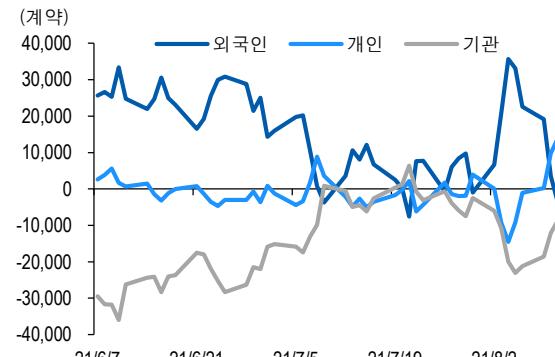
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,156,912	294.2	1,115,895	12.6%	지수옵션 전체	4,475,274	742.6	2,884,755
Put	2,318,362	448.4	1,768,860	12.0%	PCR(금액기준)	1.52	VKOSPI	15.12%(+0.60%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	435.0(K+3)	0.02	-0.21	289,337	45,001	1,006	14.4	430.0(K+1)
	432.5(K+2)	0.04	-0.59	481,086	45,944	18,465	12.6	427.5(K+0)
	430.0(K+1)	0.13	-1.30	545,641	45,053	19,212	11.7	425.0(K-1)
	427.5(K+0)	0.50	-2.26	371,058	27,543	15,899	11.8	422.5(K-2)
	425.0(K-1)	1.43	-3.21	123,842	17,475	9,226	12.3	420.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	430.0(K+1)	5.18	2.78	52,035	22,044	-875	7.0	
	427.5(K+0)	3.07	1.73	175,589	22,381	-32	9.9	
	425.0(K-1)	1.48	0.83	446,101	32,414	-2,830	10.8	
	422.5(K-2)	0.63	0.31	546,313	27,453	-5,891	12.0	
	420.0(K-3)	0.25	0.09	452,570	40,420	4,026	13.1	

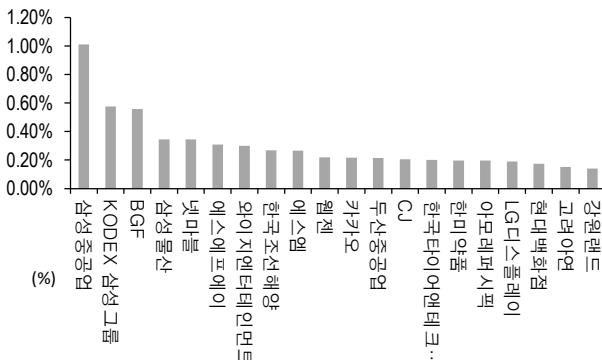
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,410,945	5,301.8	7,190,957	-90,163	124,629	-164,498	51,877	78.7	-96.8	24.8
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
NAVER	444,500	-0.45	190.1	95.8	27,894	-39,329	-0.02%	-146	-1,733	1,879
GS건설	42,200	0.36	15.3	91.6	22,015	-15,442	0.08%	2,310	-2,612	302
삼성SDI	802,000	0.12	202.7	90.0	9,979	-21,158	0.02%	-413	51	367
하나금융지주	45,000	2.16	40.7	86.3	43,175	-17,025	0.00%	7,289	-2,863	-3,978
LG화학	851,000	0.12	150.0	78.3	8,134	-8,190	-0.08%	-871	641	231
POSCO	345,500	2.52	116.2	76.8	15,697	519	0.04%	2,691	-670	-2,056
호텔신라	91,900	-0.43	12.6	71.3	16,809	-2,739	-0.01%	256	-419	155
SK텔레콤	293,000	-3.14	64.3	66.8	6,013	-4,739	0.02%	-449	566	-122
삼성전기	183,500	-1.61	55.1	57.7	19,618	-4,183	0.02%	1,236	-2,831	1,578
KT	34,800	4.19	48.0	57.1	38,745	-10,443	0.05%	20,725	-12,816	-8,305

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터