

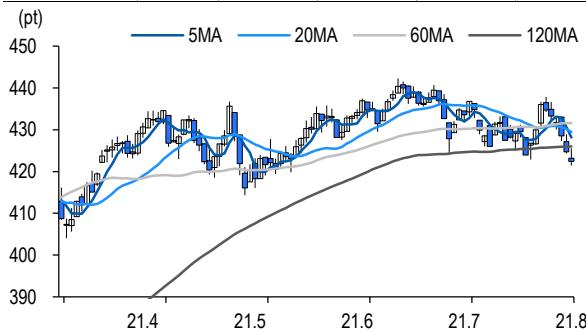


선물옵션시장 지표

2021.8.13

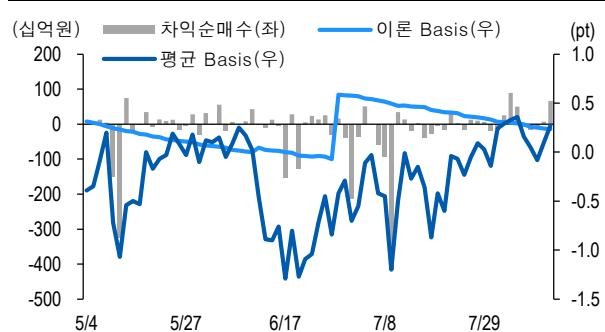
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	422.38	-0.56	-2.36	15,844.6	-
선물 9월물	423.35	-0.39	-1.65	26,365.0	261,564
선물 12월물	422.90	-0.45	-1.90	97.3	31,551
8월물(mini)	422.40	-0.59	-2.52	1,534.6	0
9월물(mini)	423.60	-0.33	-1.40	1,339.7	38,490



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.23	0.27	0.97	0.01%
베이시스(mini)	0.00	0.00	0.02	0.00%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.47	-0.45	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.00	0.00	0.00%



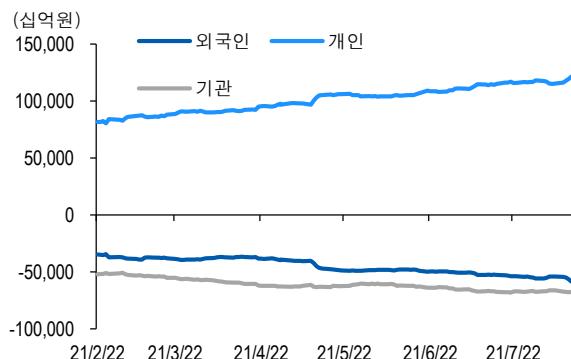
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,877.5	-35.2	-1,912.7	0.0	-333.5	238.6	-123.7	1.1	2.1	-12.1
개인	1,824.1	13.4	1,837.5	0.0	12.2	208.1	-40.3	-0.1	0.9	57.6
기관	54.2	19.2	73.4	66.6	133.3	-480.1	154.5	-0.1	-3.3	-46.7
금융투자	151.2	26.4	177.6	70.4	90.8	-691.5	167.0	4.6	-3.0	51.1
투신	21.9	14.4	36.2	4.2	23.9	251.1	-6.7	-1.5	-0.1	-26.8
은행+보험+기타금융	-3.1	-14.3	-17.4	0.0	5.2	-23.1	-5.9	-3.1	-0.5	1.2
연기금+국가지자체	-116.6	-0.3	-116.9	-8.1	3.9	-16.6	0.0	-0.2	0.2	-72.3
기타법인	-0.8	2.6	1.8	0.0	0.4	33.3	9.5	-0.9	0.3	1.2

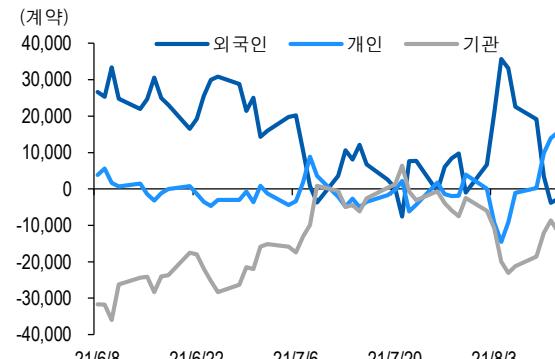
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,207,687	261.8	490,856	8.5%	지수옵션 전체	4,740,419	655.6	1,488,976							
Put	2,532,732	393.8	998,120	6.2%	PCR(금액기준)	1.50	VKOSPI	14.09%(-1.03%p)							
<hr/>															
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	432.5(K+3)	0.01	-0.03	93,116	0	-45,944	18.5	Put	427.5(K+1)	5.14	2.07	55,727	0	-22,381	12.0
	430.0(K+2)	0.01	-0.12	252,984	0	-45,053	14.5		425.0(K+0)	2.63	1.15	312,175	0	-32,414	6.4
	427.5(K+1)	0.01	-0.49	521,595	0	-27,543	10.3		422.5(K-1)	0.37	-0.26	739,547	0	-27,453	3.5
	425.0(K+0)	0.01	-1.42	703,905	0	-17,475	5.8		420.0(K-2)	0.02	-0.23	696,044	0	-40,420	6.1
	422.5(K-1)	0.27	-2.80	337,271	0	-3,125	3.7		417.5(K-3)	0.01	-0.10	238,395	0	-41,330	10.0

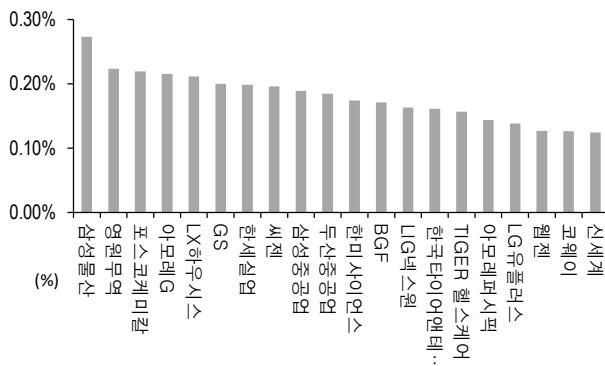
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	6,491,732	6,080.9	5,456,854	-1,734,103	-61,737	31,986	27,548	-12.1	57.6	-46.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
아모레 G	57,800	-0.17	9.6	79.4	0	-13,233	0.22%	-1,671	-201	1,872
하나투어	77,400	-0.64	4.8	69.8	0	-5,767	-0.17%	-56	780	-734
아모레퍼시픽	224,000	0.22	32.2	62.6	0	-10,571	0.14%	-27	-433	455
두산밥캣	43,850	0.80	9.7	52.6	0	-36,264	-0.20%	800	-7,261	6,510
롯데케미칼	256,000	-1.16	16.5	52.0	0	-10,904	0.07%	-35	5	-150
엔씨소프트	803,000	1.39	51.0	48.5	0	-5,221	0.07%	213	992	-1,208
LG 이노텍	210,500	-1.17	18.2	42.9	0	-13,355	0.11%	-599	-226	819
호텔신라	92,000	0.11	10.3	41.4	0	-16,809	-0.08%	-829	1,401	-576
GS 건설	42,550	0.83	8.1	40.0	0	-22,015	0.07%	-2,872	1,203	1,664
POSCO	340,500	-1.45	55.9	37.2	0	-15,697	-0.09%	-1,304	-161	1,432

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터