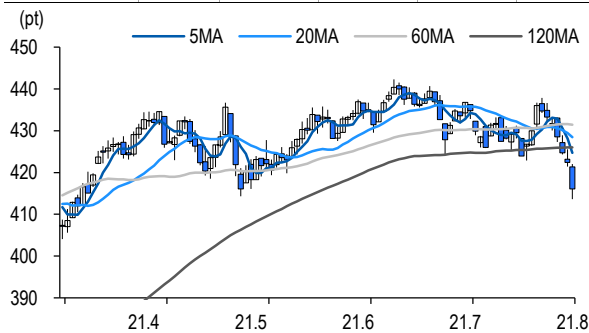


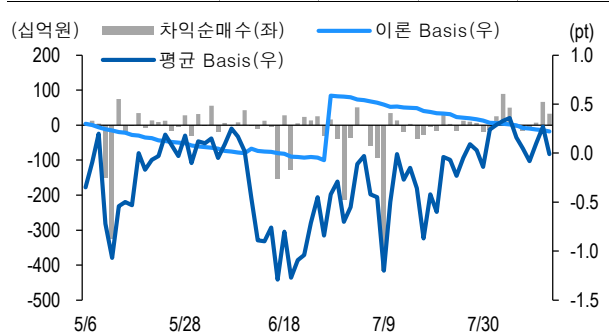
선물옵션시장 지표

2021.8.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	416.06	-1.50	-6.32	14,121.4	-
선물 9월물	416.10	-1.71	-7.25	31,363.6	267,232
선물 12월물	415.60	-1.73	-7.30	142.3	31,652
9월물(mini)	416.04	-1.73	-7.56	2,279.7	44,410
10월물(mini)	415.16	-1.78	-7.54	5.0	544



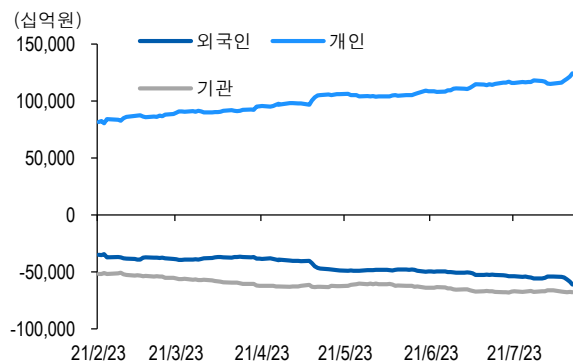
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.22	-0.01	0.04	-0.06%
베이스(mini)	0.22	-0.01	-0.02	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.47	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.22	-0.03	-0.03	-0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-2,693.2	22.1	-2,671.0	0.0	-1,440.0	-832.8	-71.8	0.1	-0.4	28.2
개인	2,803.1	27.5	2,830.7	0.0	-2.7	-48.3	89.0	-3.2	1.1	-141.3
기관	-164.0	-51.8	-215.8	32.5	86.3	808.3	-9.7	3.4	-3.5	122.0
금융투자	-206.3	-130.6	-336.9	36.5	71.4	759.8	-9.9	5.2	-2.0	224.4
투신	-26.2	51.7	25.5	2.1	-38.0	104.6	0.1	-1.0	-0.9	-67.5
은행+보험+기타금융	3.1	33.9	37.0	0.0	2.0	-54.1	0.0	-0.7	-0.7	0.6
연기금+국가지자체	71.9	14.5	86.4	-10.1	18.9	-1.9	0.0	0.0	0.0	-35.4
기타법인	54.0	2.1	56.1	0.0	-0.4	72.8	-7.4	-0.3	2.8	-8.9

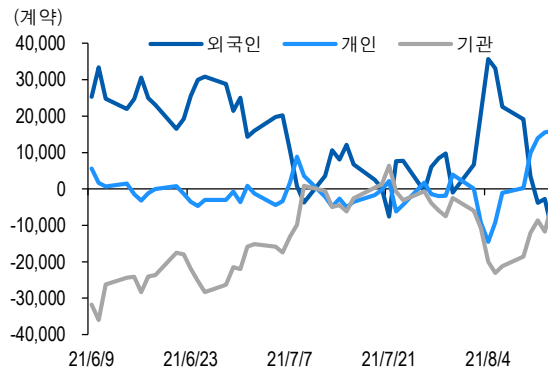
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



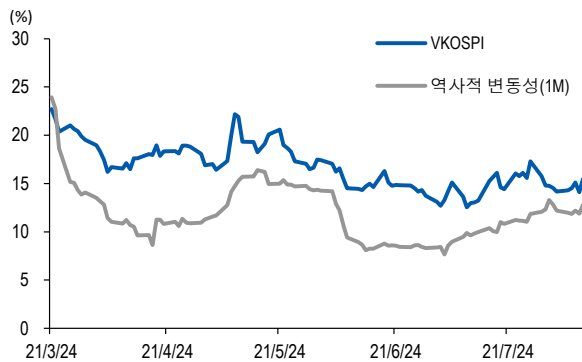
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	781,860	227.8	608,396	12.8%	지수옵션 전체	1,905,944	670.3	1,742,695
Put	1,124,084	442.5	1,134,299	14.2%	PCR(금액기준)	1.94	VKOSPI	15.45%(+1.36%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	1.43	-1.60	83,571	14,278	6,956	12.7	Put	425.0(K+1)	11.55	4.79	2,390	6,993	137	13.5
	427.5(K+2)	2.00	-1.96	42,289	8,137	6,119	12.9		422.5(K+0)	9.89	4.38	3,727	3,540	114	13.6
	425.0(K+1)	2.65	-2.49	31,768	7,093	2,826	13.0		420.0(K-1)	8.44	3.82	9,197	9,082	632	13.9
	422.5(K+0)	3.42	-3.03	21,827	5,057	2,331	13.0		417.5(K-2)	7.14	3.40	5,924	3,786	296	14.2
	420.0(K-1)	4.43	-3.54	23,099	7,435	2,954	13.2		415.0(K-3)	5.94	2.80	21,451	9,506	503	14.3

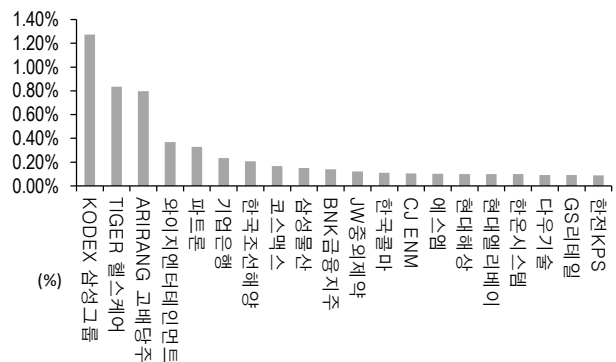
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	6,184,397	5,200.9	5,666,767	209,913	12,107	-92,866	86,607	28.2	-141.3	122.0	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,600	-1.33	70.9	123.3	149,812	5,647	-0.01%	-1,414	4,799	-3,362	-2,345	-913
KB 금융	53,200	-0.56	57.8	88.3	55,093	3,736	-0.02%	4,287	424	-4,711	-974	-3,647
삼성 SDI	816,000	-0.12	235.2	87.6	33,445	-3,608	-0.11%	147	-4,398	4,717	2,823	1,317
SK 텔레콤	307,500	-0.49	68.7	87.3	13,520	252	-0.07%	-155	-439	594	1,254	-660
NAVER	436,500	-1.02	164.1	78.1	80,092	278	0.05%	2,529	-1,446	-1,048	1,221	-1,119
POSCO	341,000	0.29	88.1	76.5	12,449	1,362	-0.02%	809	527	-1,341	418	-1,783
LG 이노텍	213,500	1.91	33.3	70.1	9,866	479	0.01%	616	1,313	-1,925	-461	-33
LG 전자	150,500	-0.99	95.8	69.9	39,976	-9,063	-0.26%	5,501	-10,820	5,319	8,560	-1,910
KT	34,300	-0.15	24.6	66.5	75,470	10,895	0.04%	10,009	1,397	-11,422	-6,409	-5,013
현대건설	51,900	-1.14	18.2	61.6	17,485	-792	-0.01%	3,415	-3,807	342	514	-172

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터