

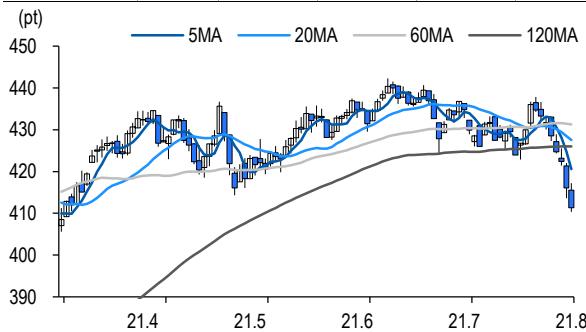


선물옵션시장 지표

2021.8.18

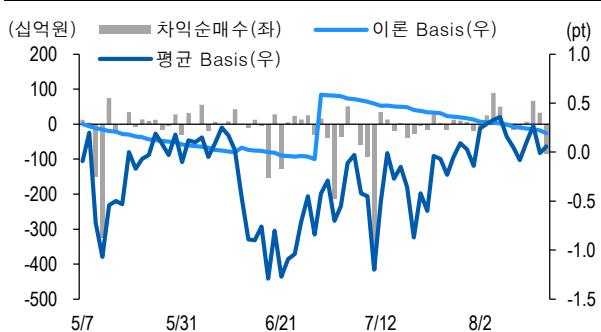
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	411.31	-1.14	-4.75	15,329.6	-
선물 9월물	411.75	-1.05	-4.35	30,868.1	264,934
선물 12월물	411.25	-1.05	-4.35	171.7	32,098
9월물(mini)	411.78	-1.04	-4.26	1,905.2	44,621
10월물(mini)	411.36	-0.92	-3.80	3.8	594



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.19	0.06	0.44	-0.03%
베이시스(mini)	0.19	0.06	0.47	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.42	-0.40	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	0.45	0.45	0.06%



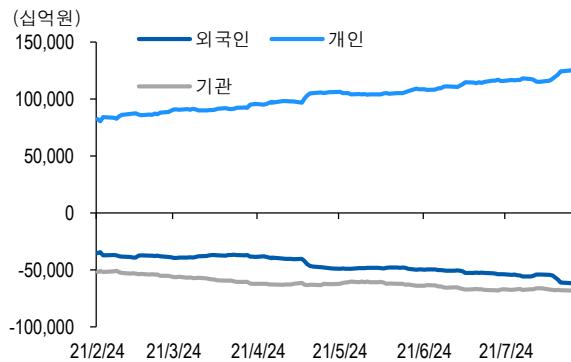
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-417.0	-31.3	-448.3	-99.4	42.9	147.8	18.6	0.1	-2.4	-17.2
개인	584.5	179.6	764.1	0.0	-2.5	-11.3	-13.9	-2.9	3.2	-96.7
기관	-128.8	-149.8	-278.6	14.9	-17.5	-62.4	-19.1	3.5	0.0	106.9
금융투자	-81.0	-271.8	-352.9	8.8	11.8	-210.3	-19.0	3.6	0.0	112.8
투신	43.2	10.3	53.5	0.0	16.2	343.2	0.0	-0.1	0.1	-8.0
은행+보험+기타금융	9.2	117.9	127.1	0.0	11.6	-193.9	-0.1	0.0	-0.2	-0.1
연기금+국가지자체	-33.3	0.7	-32.6	6.1	-64.9	-1.4	0.0	0.0	0.0	2.2
기타법인	-38.7	1.5	-37.2	0.0	0.0	-74.1	14.3	-0.7	-0.8	7.0

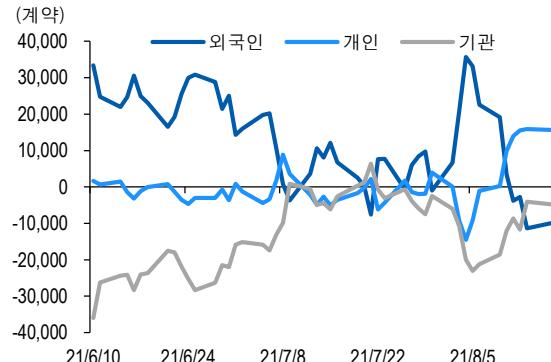
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



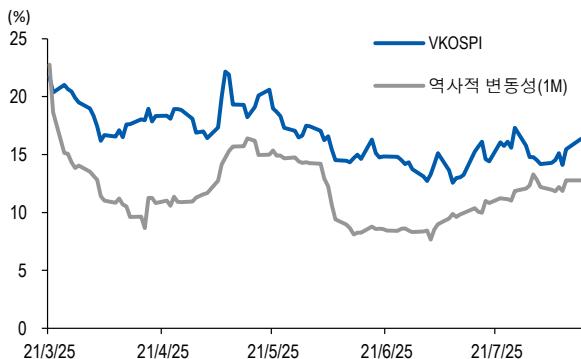
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	734,703	213.0	668,185	14.4%	지수옵션 전체	1,732,391	605.8	1,864,308						
Put	997,688	392.8	1,196,123	15.6%	PCR(금액기준)	1.84	VKOSPI	16.34% (+0.89%p)						
Call	422.5(K+3)	2.10	-1.32	36,112	7,164	2,107	14.3	417.5(K+1)	9.44	2.30	3,894	3,522	-264	14.1
	420.0(K+2)	2.83	-1.60	25,495	8,850	1,415	14.5	415.0(K+0)	8.01	2.07	8,526	9,402	-104	14.4
	417.5(K+1)	3.68	-1.99	16,803	3,865	1,362	14.7	412.5(K-1)	6.80	1.81	8,811	5,287	-122	14.9
	415.0(K+0)	4.77	-2.18	15,000	4,069	1,429	15.1	410.0(K-2)	5.73	1.51	22,194	16,102	531	15.4
	412.5(K-1)	6.07	-2.43	4,624	1,203	850	15.6	407.5(K-3)	4.83	1.32	21,146	5,204	15	15.9

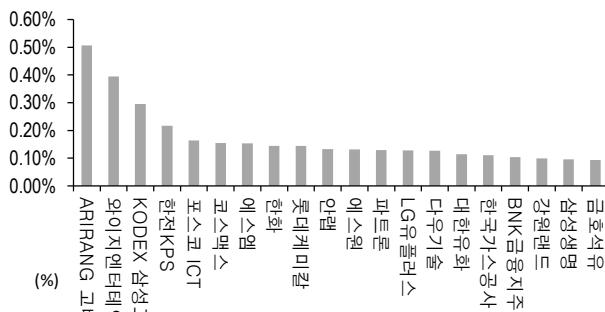
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,525,867	3,901.0	5,713,821	47,054	-38,566	-92,083	127,569	-17.2	-96.7	106.9
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
하나금융지주	44,500	-0.22	30.9	67.0	149,623	-189	0.03%	2,155	69	-2,224
넷마블	125,000	-0.79	21.5	64.2	9,748	-2,953	-0.08%	600	-1,093	493
LG 화학	895,000	0.45	150.5	58.9	14,329	24	-0.28%	61	-2,811	2,750
현대엘리베이	49,800	-2.92	10.8	57.6	24,549	-1,950	0.02%	-2,072	556	1,516
삼성 SDI	793,000	-2.82	177.3	56.7	32,479	-966	0.01%	-143	-811	874
삼성전자	74,300	0.00	1,281.8	56.3	1,334,812	-15,615	-0.03%	4,828	-69,768	63,827
NAVER	428,500	-1.83	181.7	56.0	80,146	54	0.09%	-201	2,901	-2,630
현대제철	48,950	-3.26	23.6	54.7	28,330	2,534	0.02%	-344	2,233	-1,890
영진약품	5,380	-0.74	1.8	53.9	13,508	3,260	-0.06%	4,386	318	-4,704
호텔신라	86,800	-3.77	22.7	52.4	18,005	426	-0.14%	-889	590	274

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터