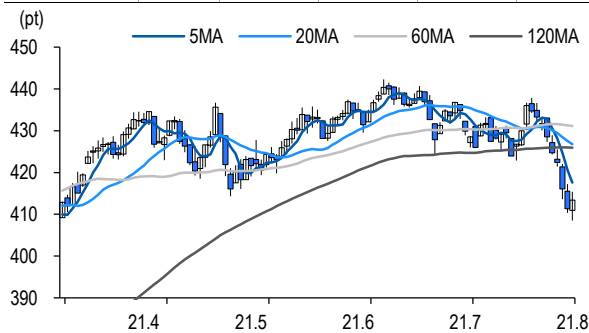


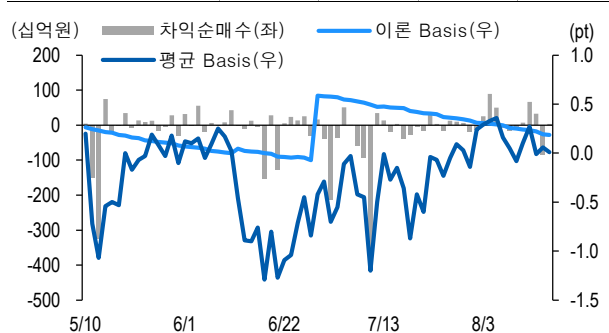
## 선물옵션시장 지표

2021.8.19

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	413.36	0.50	2.05	10,205.3	-
선물 9월물	413.05	0.32	1.30	29,252.1	262,114
선물 12월물	412.70	0.35	1.45	108.8	32,170
9월물(mini)	413.04	0.31	1.26	2,007.4	43,393
10월물(mini)	412.50	0.28	1.14	4.7	600



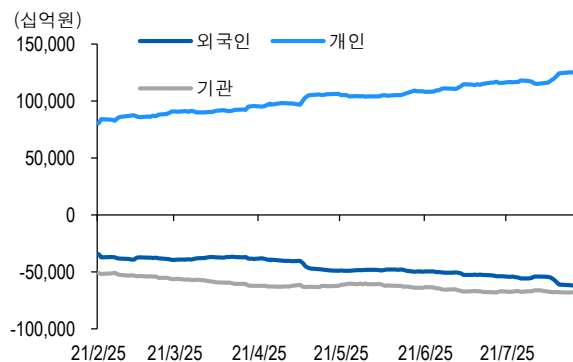
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.19	0.01	-0.31	-0.04%
베이스(mini)	0.19	0.01	-0.32	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.45	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.19	-0.31	-0.31	-0.12%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-260.8	-47.7	-308.5	-4.9	161.1	264.1	50.0	-0.3	2.0	-11.8
개인	-128.3	57.3	-71.0	0.0	1.1	-232.4	-41.9	-2.6	0.3	-9.5
기관	409.8	-11.9	397.9	8.6	159.4	-24.5	2.2	3.8	-2.3	20.3
금융투자	275.4	-185.8	89.6	17.1	62.4	-405.9	2.1	4.0	-2.0	22.0
투신	24.1	4.3	28.4	0.0	9.6	393.2	-0.1	-0.2	-0.2	14.5
은행+보험+기타금융	-2.8	162.2	159.4	0.0	2.3	-26.0	0.1	0.0	-0.1	1.6
연기금+국가지자체	92.1	10.3	102.4	-10.3	50.6	14.2	0.1	0.0	0.0	-17.8
기타법인	-20.8	2.4	-18.4	0.0	-0.7	-7.2	-10.3	-0.8	-0.1	1.1

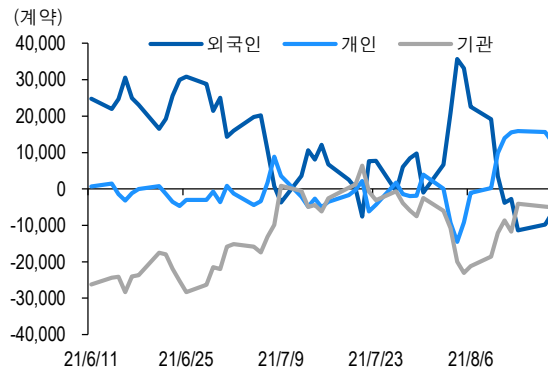
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

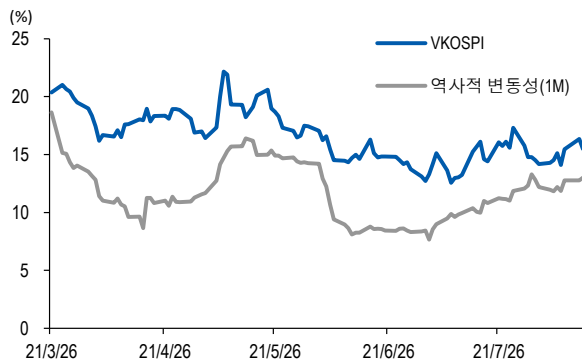
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	778,373	269.9	710,638	13.1%	지수옵션 전체	1,635,285	575.4	1,944,881
Put	856,912	305.5	1,234,243	16.0%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	15.48%(-0.86%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	2.86	0.03	75,143	11,753	2,903	13.2	Put	415.0(K+1)	6.91	-1.10	3,910	9,971	569	14.9
	417.5(K+2)	3.80	0.12	31,025	5,160	1,295	13.3		412.5(K+0)	5.75	-1.05	7,910	5,664	377	15.1
	415.0(K+1)	4.96	0.19	17,183	5,131	1,062	13.6		410.0(K-1)	4.75	-0.98	14,343	15,677	-425	15.4
	412.5(K+0)	6.30	0.23	6,515	1,659	456	13.9		407.5(K-2)	3.95	-0.88	14,160	5,777	573	15.9
	410.0(K-1)	7.80	0.32	4,631	2,347	322	14.2		405.0(K-3)	3.26	-0.78	28,566	10,151	261	16.3

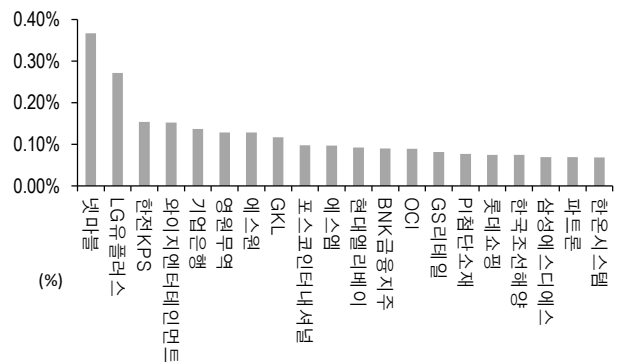
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 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	4,829,452	3,999.7	5,818,751	104,930	15,305	-11,732	-4,826	-11.8	-9.5	20.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대제철	49,300	0.72	43.5	128.0	29,699	1,369	-0.04%	2,022	-179	-1,843	-1,695	-148
하나금융지주	44,500	0.00	31.1	94.4	148,988	-635	-0.01%	230	424	-669	-460	-205
넷마블	129,500	3.60	23.2	90.9	8,556	-1,192	0.37%	1,364	9	-1,373	-4,989	-874
NAVER	429,500	0.23	177.1	89.1	79,739	-407	0.05%	-604	461	98	-1,455	779
삼성 SDI	795,000	0.25	148.9	86.7	32,202	-277	-0.13%	-259	-1,569	1,793	1,490	312
LG 화학	896,000	0.11	125.9	85.9	14,560	231	-0.19%	-795	733	62	521	-284
LG 전자	153,000	1.32	75.2	75.9	39,328	1,701	-0.01%	1,208	87	-1,295	-1,111	-316
GS 건설	40,850	1.11	10.8	74.6	38,075	28	0.00%	-225	12	213	804	-580
셀트리온	273,000	0.00	84.6	74.1	37,592	419	-0.19%	-259	-41	322	775	0
호텔신라	88,200	1.61	21.2	72.6	18,232	227	-0.05%	2,027	-523	-1,379	-810	-601

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터