

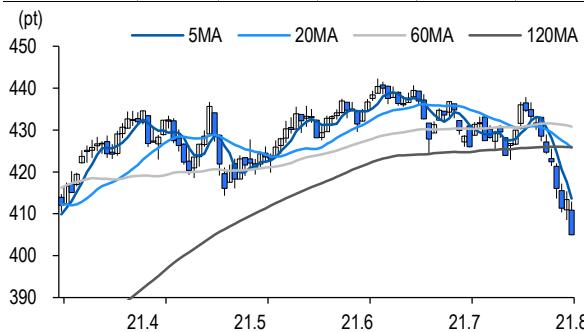


선물옵션시장 지표

2021.8.20

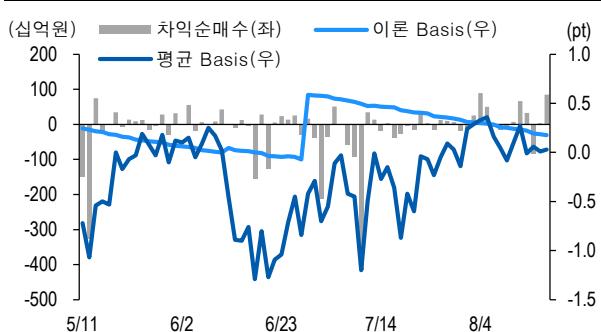
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	404.96	-2.03	-8.40	10,871.4	-
선물 9월물	404.85	-1.99	-8.20	39,963.9	265,729
선물 12월물	404.70	-1.94	-8.00	218.7	32,216
9월물(mini)	404.96	-1.96	-8.08	2,677.4	44,775
10월물(mini)	404.82	-1.86	-7.68	8.3	696



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.18	0.03	-0.11	-0.04%
베이시스(mini)	0.18	0.02	0.00	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.45	-0.45	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.18	-0.09	-0.09	-0.07%



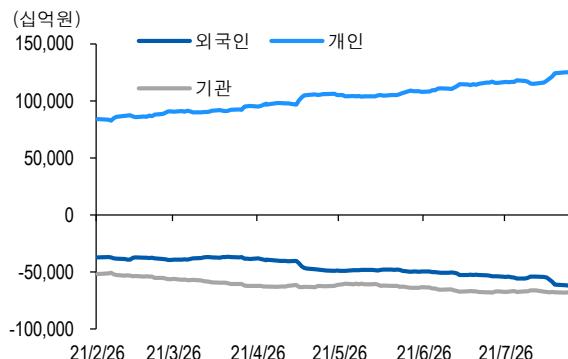
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-327.1	12.0	-315.2	0.0	-264.1	-84.8	-51.5	0.4	-0.9	-29.2
개인	803.7	68.6	872.3	0.0	-3.2	111.9	37.2	-2.1	7.5	-59.4
기관	-417.4	-83.0	-500.4	84.8	59.7	-65.8	4.6	2.1	-7.2	90.3
금융투자	-186.5	-228.6	-415.2	76.6	51.0	182.7	5.3	3.1	-7.2	67.8
투신	-95.1	8.9	-86.2	0.0	-2.2	-347.9	-0.6	-0.2	0.1	0.1
은행+보험+기타금융	-13.1	120.6	107.6	0.0	2.5	105.2	0.0	-0.7	-0.1	0.9
연기금+국가지자체	-21.4	33.6	12.2	8.2	-0.9	-5.7	-0.1	0.0	0.0	21.5
기타법인	-59.2	2.4	-56.8	0.0	-2.5	38.7	9.6	-0.4	0.6	-1.7

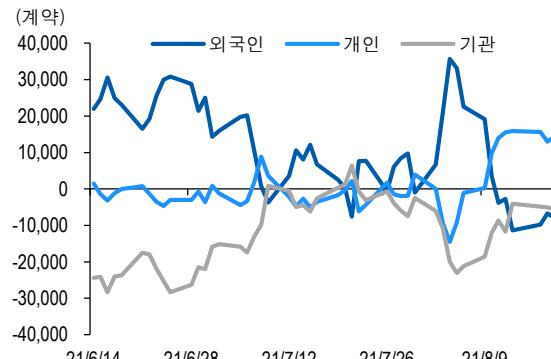
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	965,839	297.1	764,622	14.7%	지수옵션 전체	2,259,861	783.1
Put	1,294,022	486.0	1,313,193	17.0%	PCR(금액기준)	1.64	VKOSPI 17.82%(+2.34%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	1.21	-1.65	101,509	17,556	5,803	14.6
	417.5(K+2)	1.69	-2.11	57,090	8,985	3,825	14.7
	415.0(K+1)	2.37	-2.59	33,295	7,960	2,829	15.1
	412.5(K+0)	3.17	-3.13	26,013	4,026	2,367	15.4
	410.0(K-1)	4.17	-3.63	16,793	5,057	2,710	15.8
Put	415.0(K+1)	12.50	5.59	3,209	9,703	-268	15.9
	412.5(K+0)	10.80	5.05	7,445	5,641	-23	16.2
	410.0(K-1)	9.18	4.43	13,254	15,016	-661	16.2
	407.5(K-2)	7.94	3.99	15,155	6,156	379	16.8
	405.0(K-3)	6.69	3.43	30,875	11,087	936	17.0

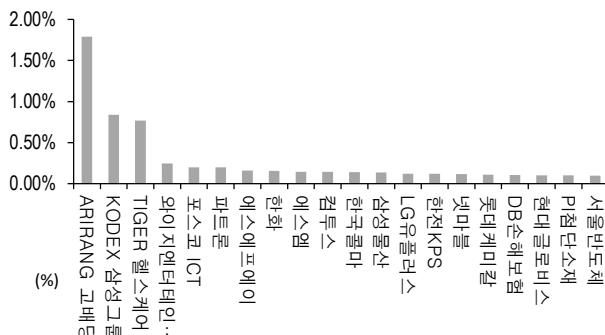
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	5,001,317	4,240.3	5,766,480	-52,271	-91,964	629	95,161	-29.2	-59.4	90.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	73,200	-1.08	1,343.0	82.7	1,357,355	-20,856	-0.03%	23,696	-11,104	-11,026
NAVER	425,000	-1.05	159.7	74.1	78,889	-850	0.03%	-1,189	-221	1,475
하나금융지주	42,700	-4.04	41.9	73.6	150,565	1,577	0.00%	2,043	3,441	-6,259
LG 화학	891,000	-0.56	150.6	67.2	14,722	162	-0.12%	722	-924	178
LG 전자	147,500	-3.59	73.6	67.0	35,342	-3,986	-0.13%	-5,859	-1,714	7,573
SK 텔레콤	290,500	-1.53	48.0	66.3	15,109	250	-0.14%	-1,895	-452	2,347
현대건설	48,750	-5.16	28.7	64.4	19,910	1,140	0.00%	298	-31	-377
한미사이언스	73,100	-1.35	10.5	62.2	7,466	-6,683	0.03%	-1,389	7,362	-5,974
삼성 SDI	777,000	-2.26	133.5	62.2	31,410	-792	-0.05%	443	-185	-237
SK 하이닉스	103,000	-0.96	389.2	61.5	187,059	-18,789	-0.02%	3,760	-15,498	11,736

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터