

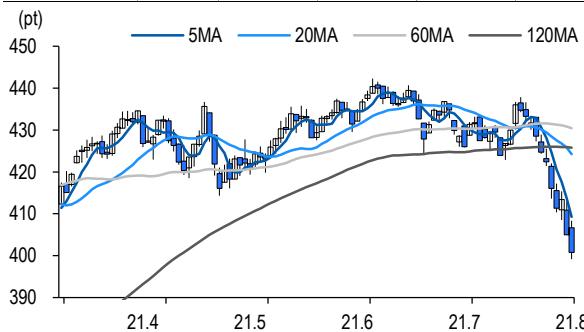


선물옵션시장 지표

2021.8.23

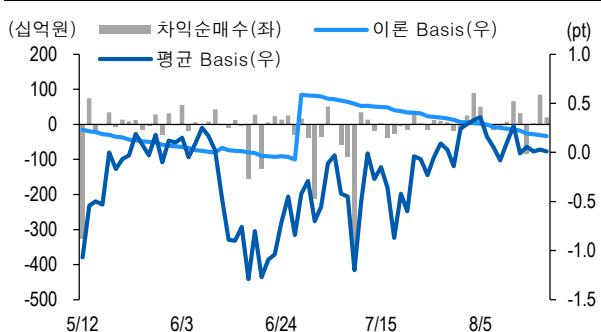
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	400.78	-1.03	-4.18	10,447.0	-
선물 9월물	400.90	-0.98	-3.95	45,413.8	273,245
선물 12월물	400.60	-1.01	-4.10	323.0	32,451
9월물(mini)	400.90	-0.98	-4.06	2,843.4	44,376
10월물(mini)	400.70	-1.02	-4.12	5.6	723



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.17	0.01	0.12	-0.04%
베이시스(mini)	0.17	0.01	0.12	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.45	-0.45	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.17	0.11	0.11	-0.01%



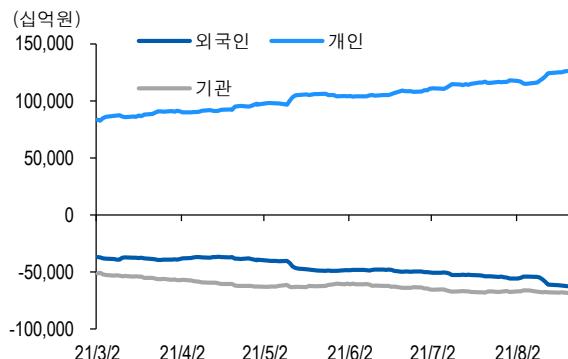
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-256.7	5.2	-251.6	0.7	-68.8	415.1	38.8	-1.5	-9.0	26.2
개인	273.8	12.8	286.6	0.0	-2.0	-428.4	-37.4	-3.4	17.7	17.6
기관	-15.9	-23.2	-39.2	19.5	17.9	102.4	-2.5	5.3	-10.1	-41.4
금융투자	-6.7	-160.9	-167.6	17.6	24.3	192.7	-2.5	5.6	-9.4	-28.2
투신	-7.8	-33.4	-41.2	0.0	-8.0	-10.1	0.2	-0.2	0.0	9.1
은행+보험+기타금융	-3.8	111.9	108.2	0.0	4.4	-65.4	0.0	0.0	-0.8	0.3
연기금+국가지자체	33.7	63.3	97.0	2.0	-11.0	-14.8	-0.1	0.0	0.0	-22.5
기타법인	-1.1	5.3	4.2	0.0	-2.4	-89.1	1.1	-0.4	1.5	-2.4

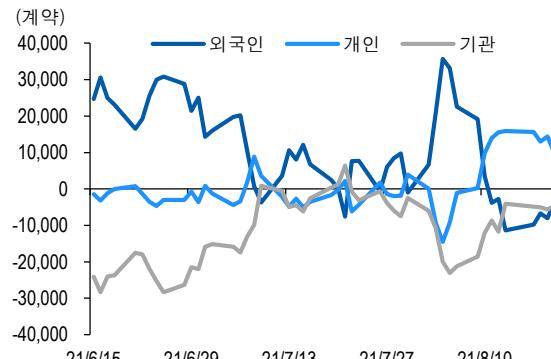
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



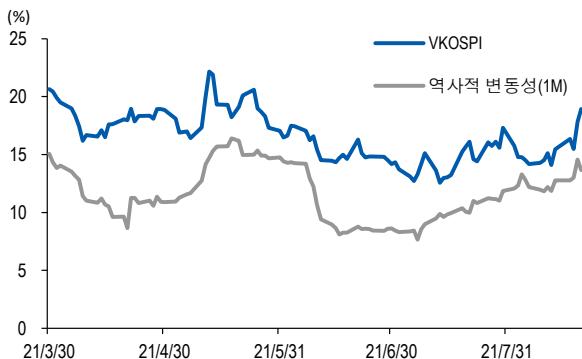
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,216,322	396.4	827,596	16.3%	지수옵션 전체	3,043,549	1,057.5	2,218,659							
Put	1,827,227	661.1	1,391,063	18.6%	PCR(금액기준)	1.67	VKOSPI	18.92%(+1.10%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	412.5(K+3)	2.16	-1.01	80,089	8,019	3,993	16.3	Put	407.5(K+1)	10.45	2.51	5,052	6,208	52	17.3
	410.0(K+2)	2.90	-1.27	47,578	10,224	5,167	16.6		405.0(K+0)	8.98	2.29	9,662	10,615	-472	17.6
	407.5(K+1)	3.80	-1.54	23,340	3,018	1,119	17.0		402.5(K-1)	7.73	1.95	12,927	8,312	-870	18.0
	405.0(K+0)	4.87	-1.71	16,019	2,882	2,309	17.4		400.0(K-2)	6.61	1.72	41,166	26,595	-319	18.5
	402.5(K-1)	6.11	-2.39	4,767	1,513	1,020	17.8		397.5(K-3)	5.65	1.55	32,849	9,531	31	19.0

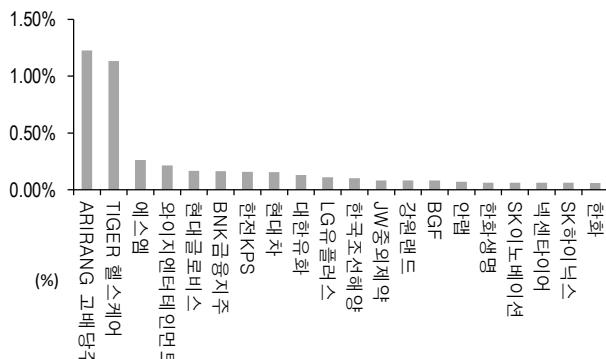
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 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	5,365,817	4,377.0	5,804,269	37,789	71,338	15,623	-87,981	26.2	17.6	-41.4
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
현대제철	46,000	-0.97	58.4	122.0	25,195	-2,607	0.00%	7,473	-9,238	1,876
현대건설	48,500	-0.51	38.5	105.6	20,536	626	0.02%	483	2,012	-2,404
아모레퍼시픽	215,500	1.65	25.6	94.3	11,575	462	-0.14%	274	-208	-58
두산밥캣	40,150	-0.12	9.1	88.1	48,414	-3,894	-0.37%	-2,429	-30	2,507
삼성 SDI	775,000	-0.26	180.1	81.4	31,234	-176	0.03%	430	215	-528
삼성전자	72,800	-0.55	1,263.2	77.8	1,372,566	15,211	0.00%	9,004	13,060	-22,248
엔씨소프트	829,000	-3.15	139.3	77.8	5,375	159	0.03%	-580	1,521	-927
SK 이노베이션	233,500	1.74	106.9	74.4	24,109	403	0.06%	2,311	333	-2,677
NAVER	423,000	-0.47	185.6	74.3	78,959	70	0.02%	-22	654	-630
하나금융지주	41,900	-1.87	43.4	74.3	146,682	-3,883	0.00%	-832	-129	312

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터