

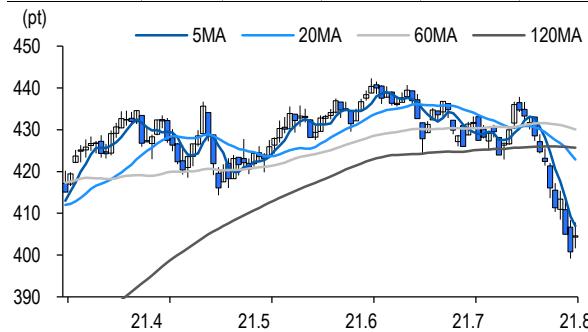


선물옵션시장 지표

2021.8.24

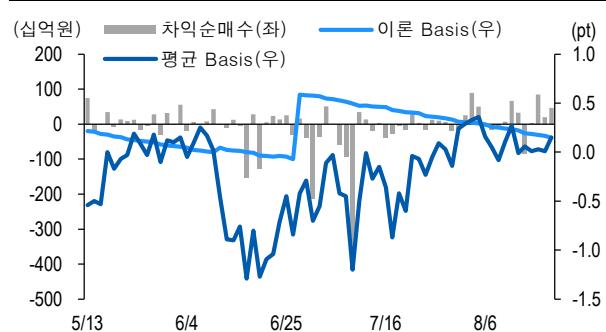
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	404.58	0.95	3.80	9,484.4	-
선물 9월물	405.15	1.06	4.25	29,477.2	271,161
선물 12월물	404.70	1.02	4.10	155.2	32,876
9월물(mini)	405.16	1.06	4.26	2,093.1	45,594
10월물(mini)	404.10	0.85	3.40	9.1	814



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.15	0.15	0.57	0.00%
베이시스(mini)	0.15	0.15	0.58	0.00%
제1스프레드(SP)	0.17	-0.42	-0.40	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.15	0.53	0.53	0.10%



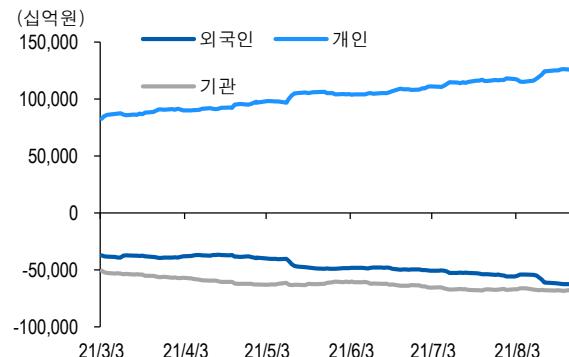
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-31.1	-11.6	-42.7	0.1	195.3	197.9	46.5	2.5	-0.4	-10.8
개인	-572.2	-11.5	-583.7	0.0	-1.4	-140.3	-28.9	-2.7	-0.7	84.9
기관	609.9	9.5	619.4	46.5	98.6	-29.0	-1.5	0.8	1.2	-77.6
금융투자	456.7	-37.3	419.4	40.8	66.6	-405.2	-1.3	1.3	1.5	-116.1
투신	54.6	9.2	63.7	0.0	12.2	436.8	-0.1	0.2	0.2	73.7
은행+보험+기타금융	7.1	48.1	55.2	1.8	8.0	-67.9	0.0	-0.6	-0.4	-0.1
연기금+국가지자체	31.2	1.1	32.2	4.0	-10.8	7.4	0.0	0.0	0.0	-35.1
기타법인	-6.5	13.6	7.0	0.0	4.5	-28.6	-16.0	-0.6	-0.1	3.5

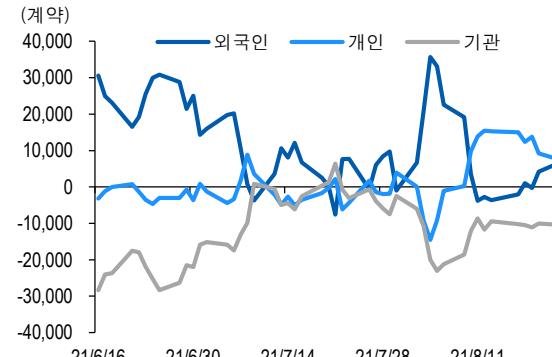
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	900,755	296.3	851,892	16.5%	지수옵션 전체		1,872,161	609.3	2,282,751			
Put	971,406	313.1	1,430,859	18.1%	PCR(금액기준)		1.06	VKOSPI	17.29%(-1.63%p)			
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정
	407.5(K+3)	4.70	0.90	18,110	3,847	829	16.6	402.5(K+1)	4.91	-2.82	14,439	8,058
	405.0(K+2)	6.01	1.14	10,603	3,351	469	17.1	400.0(K+0)	4.07	-2.54	27,161	25,629
	402.5(K+1)	7.55	1.44	4,034	1,910	397	17.8	397.5(K-1)	3.30	-2.35	21,950	9,597
	400.0(K+0)	9.18	1.68	2,591	2,809	525	18.4	395.0(K-2)	2.71	-2.09	33,493	15,818
	397.5(K-1)	10.70	1.67	520	538	279	18.2	392.5(K-3)	2.21	-1.87	35,905	13,185
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정
	402.5(K+1)	4.91	-2.82	14,439	8,058	-254	16.7	400.0(K+0)	4.07	-2.54	27,161	25,629
	400.0(K+0)	4.07	-2.54	27,161	25,629	-966	17.3	397.5(K-1)	3.30	-2.35	21,950	9,597
	397.5(K-1)	3.30	-2.35	21,950	9,597	66	17.6	395.0(K-2)	2.71	-2.09	33,493	15,818
	395.0(K-2)	2.71	-2.09	33,493	15,818	62	18.2	392.5(K-3)	2.21	-1.87	35,905	13,185
	392.5(K-3)	2.21	-1.87	35,905	13,185	492	18.7					

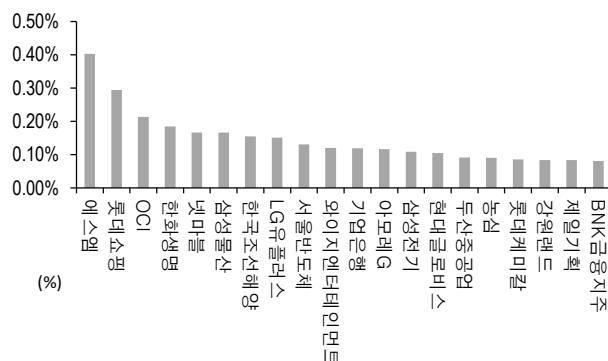
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,995,911	4,385.3	5,796,961	-7,308	68,252	58,368	-125,664	-10.8	84.9	-77.6		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
두산밥캣	41,250	2.74	13.3	123.0	43,531	-4,883	-0.01%	-2,941	1,859	1,082	-6,078	-29
삼성전자	73,500	0.96	1,410.8	99.3	1,324,316	-48,250	0.05%	-42,859	124,497	-81,671	-66,429	-31,135
하나금융지주	42,600	1.67	36.4	95.3	143,181	-3,501	-0.03%	5,829	-6,471	1,412	-1,483	2,895
현대제철	45,950	-0.11	28.6	88.6	24,702	-493	0.04%	-1,152	220	927	2,852	-1,925
NAVER	430,000	1.65	178.6	80.7	78,972	13	-0.02%	240	-703	358	-1,761	1,166
SK 이노베이션	239,000	2.36	112.9	79.6	26,453	2,344	0.01%	-668	4,064	-3,424	-1,222	-2,140
POSCO	309,500	0.32	76.0	79.4	13,875	5	-0.10%	-351	182	147	293	-470
현대건설	49,350	1.75	23.0	78.9	20,029	-507	0.05%	2,127	-1,574	-563	208	-771
엔씨소프트	826,000	-0.36	60.9	75.4	5,489	114	0.00%	86	-137	44	31	149
GS건설	38,850	0.78	11.5	72.4	35,283	-3,281	0.02%	2,212	-3,486	1,274	951	234

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터