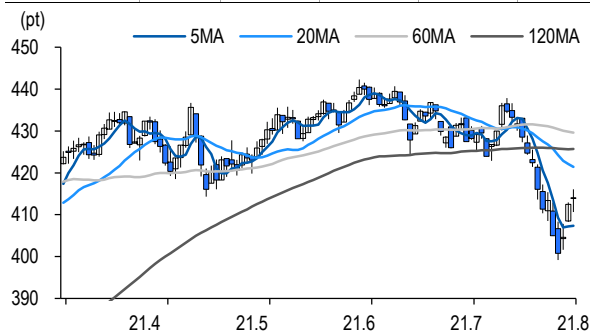


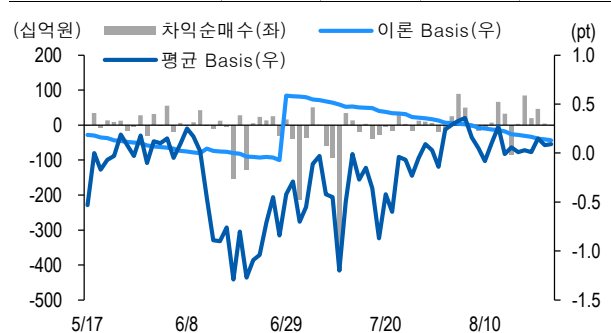
선물옵션시장 지표

2021.8.26

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	413.95	0.36	1.47	9,205.7	-
선물 9월물	413.45	0.11	0.45	33,623.8	260,954
선물 12월물	413.10	0.21	0.85	95.6	32,953
9월물(mini)	413.50	0.12	0.52	2,250.1	49,353
10월물(mini)	412.92	0.22	0.92	4.1	932



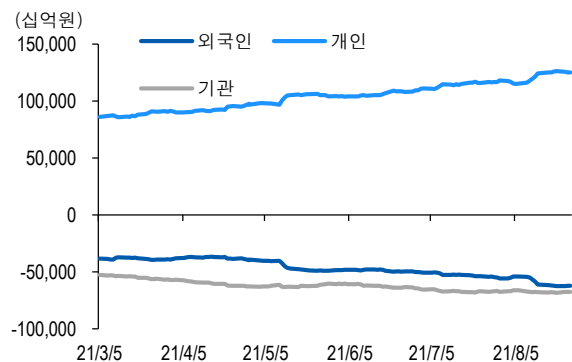
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.13	0.09	-0.50	-0.01%
베이스(mini)	0.13	0.09	-0.45	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.20	-0.40	-0.45	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	-0.47	-0.47	-0.15%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	30.0	-36.0	-6.0	0.0	-6.6	-30.6	-26.5	1.1	1.8	-3.9
개인	-26.9	35.3	8.5	0.0	-3.2	171.9	18.5	2.3	-2.4	-17.7
기관	22.0	0.1	22.1	-1.1	-26.7	-159.0	4.9	-3.8	0.7	20.6
금융투자	-10.6	-31.5	-42.1	1.0	11.6	-35.8	4.9	-3.6	0.7	30.3
투신	10.9	-5.6	5.3	0.0	-2.5	-100.6	0.0	-0.3	-0.1	-20.9
은행+보험+기타금융	-32.9	40.7	7.8	0.0	-30.8	-17.9	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	22.8	-0.3	22.5	-2.0	-7.3	-4.7	0.0	0.0	0.0	11.2
기타법인	-25.2	0.5	-24.6	0.0	2.3	17.7	3.1	0.5	-0.1	1.0

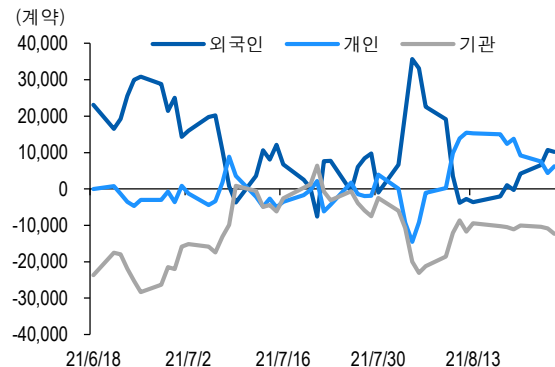
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



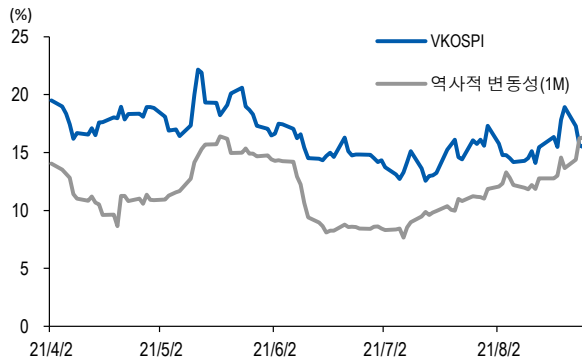
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,015,355	307.8	878,735	13.0%	지수옵션 전체	2,037,110	614.9	2,389,775
Put	1,021,755	307.1	1,511,040	16.5%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	15.48%(-0.14%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	2.14	0.06	123,536	22,297	117	12.9	Put	415.0(K+1)	5.71	-0.46	7,303	10,329	379	15.1
	417.5(K+2)	3.08	0.08	64,537	12,515	-774	13.2		412.5(K+0)	4.60	-0.36	14,224	5,550	-57	15.5
	415.0(K+1)	4.19	0.13	35,733	15,636	-586	13.4		410.0(K-1)	3.66	-0.35	32,028	16,720	732	15.9
	412.5(K+0)	5.58	0.27	14,292	9,965	169	13.7		407.5(K-2)	2.90	-0.28	35,025	7,992	796	16.3
	410.0(K-1)	7.14	0.24	5,890	10,672	138	14.0		405.0(K-3)	2.29	-0.28	82,266	13,953	2,491	16.7

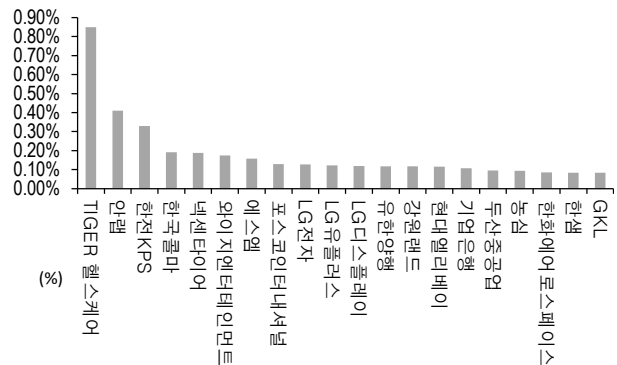
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,384,730	3,667.9	5,829,355	-27,933	-15,088	-32,300	48,620	-3.9	-17.7	20.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KT	32,800	0.61	17.3	94.8	62,383	-2,154	0.01%	6,638	-5,823	-813	-1,018	205
하나금융지주	44,700	1.36	32.5	93.9	137,184	-5,324	-0.06%	-5,028	-1,651	6,679	6,961	-280
삼성 SDI	777,000	0.91	160.4	86.2	30,301	-7	-0.02%	436	-503	54	407	-473
삼성전자	75,600	-0.13	1,435.9	85.2	1,144,295	-69,850	0.00%	-668	-39,836	41,563	24,251	26,815
현대제철	48,350	1.47	32.4	82.5	25,972	-2,671	-0.05%	-4,203	-1,263	5,456	4,423	623
POSCO	325,000	1.56	110.1	77.2	14,738	-2,424	-0.10%	-992	-827	1,819	-100	2,891
GS 건설	41,150	1.11	14.4	76.8	36,428	904	0.03%	-369	1,158	-789	-1,512	723
SK 하이닉스	103,500	-1.90	231.3	70.1	149,416	-7,990	0.01%	-11,702	-828	10,534	17,121	-1,000
한국금융지주	94,100	0.75	10.5	68.5	42,443	-1,015	-0.02%	-751	-696	1,447	218	1,357
LG 디스플레이	20,150	1.00	31.6	67.2	395,673	6,424	0.12%	22,931	-619	-22,332	-9,089	-13,243

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터