

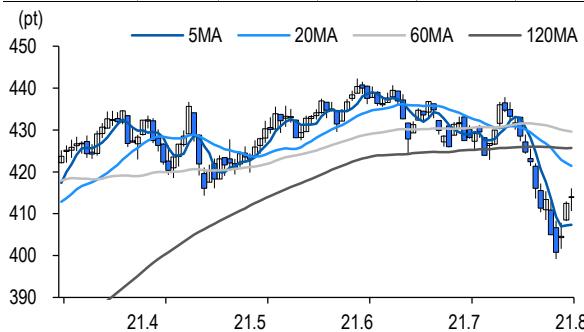


선물옵션시장 지표

2021.8.26

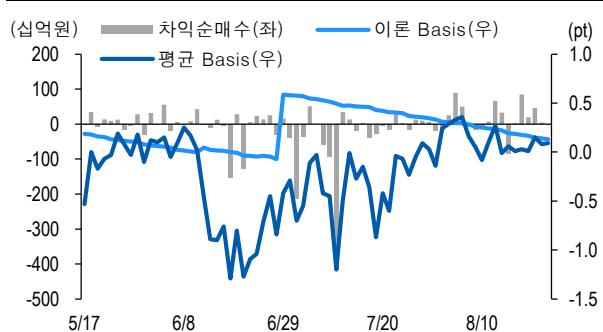
Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	0.13	0.09	-0.50	-0.01%
베이시스(mini)	0.13	0.09	-0.45	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.20	-0.40	-0.45	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-0.47	-0.47	-0.15%



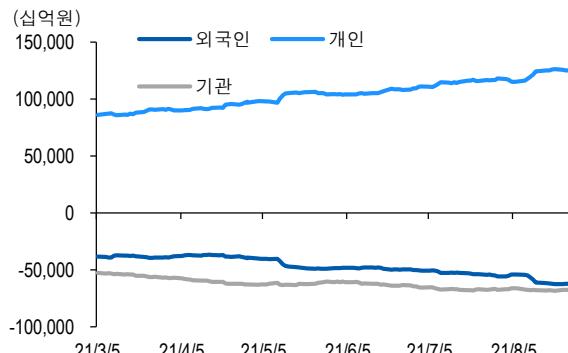
투자주체별 매매 동향

(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

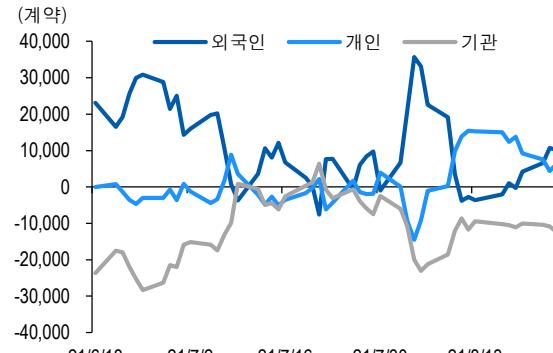
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

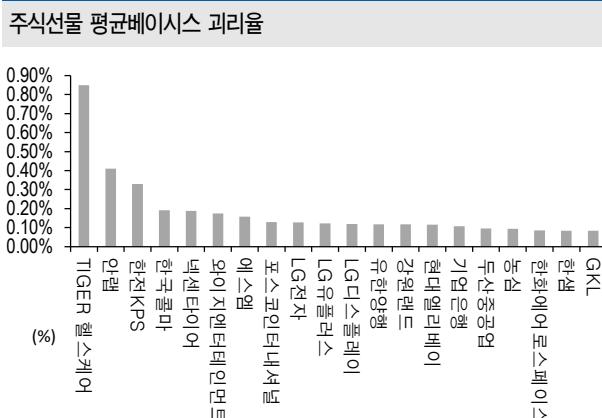


지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	1,015,355	307.8	878,735	13.0%	지수옵션 전체		2,037,110	614.9	2,389,775						
Put	1,021,755	307.1	1,511,040	16.5%	PCR(금액기준)		1.00	VKOSPI	15.48%(-0.14%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감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



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터