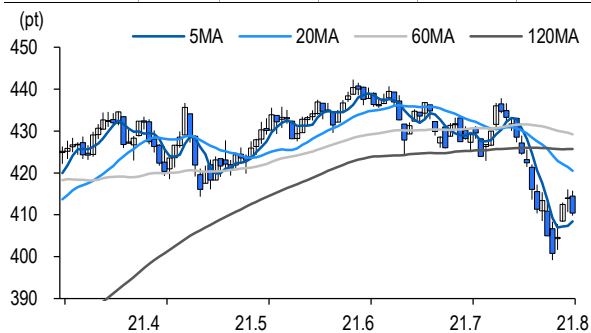


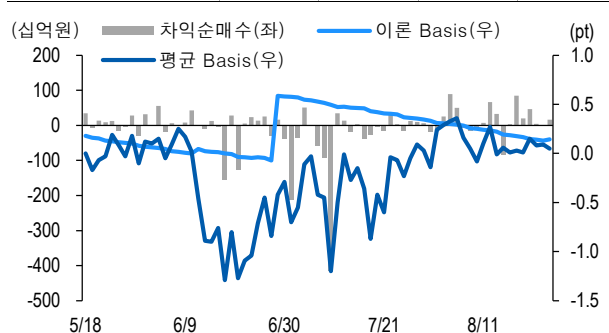
선물옵션시장 지표

2021.8.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	410.38	-0.86	-3.57	9,244.0	-
선물 9월물	410.50	-0.71	-2.95	35,422.6	256,279
선물 12월물	410.10	-0.73	-3.00	215.5	33,261
9월물(mini)	410.50	-0.72	-3.00	2,553.4	50,303
10월물(mini)	410.32	-0.63	-2.60	3.6	989



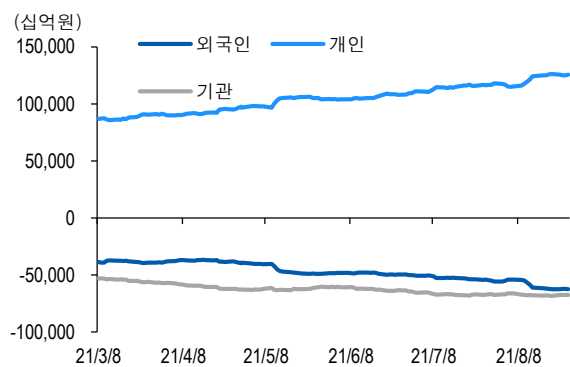
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.14	0.05	0.12	-0.02%
베이스(mini)	0.14	0.05	0.12	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.19	-0.38	-0.30	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.14	0.11	0.11	-0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-363.2	21.9	-341.3	0.0	-169.4	-84.7	-66.0	0.2	-1.7	-14.5
개인	440.0	70.7	510.8	0.0	-8.0	128.2	62.2	0.6	1.3	33.9
기관	-81.4	-94.5	-175.9	16.4	12.1	-21.3	-1.9	-0.9	0.1	-13.4
금융투자	-100.6	-141.5	-242.1	12.3	10.7	251.2	-1.9	-0.7	-0.6	-6.5
투신	36.2	1.4	37.6	6.1	-8.2	-306.7	0.0	0.0	0.0	2.5
은행+보험+기타금융	-11.3	43.1	31.8	0.0	0.6	28.6	0.0	-0.2	0.8	0.1
연기금+국가지자체	-6.9	-0.4	-7.4	-2.0	-1.0	5.6	0.0	0.0	0.0	-9.6
기타법인	4.6	1.8	6.4	0.0	0.5	-22.1	5.7	0.1	0.3	-6.0

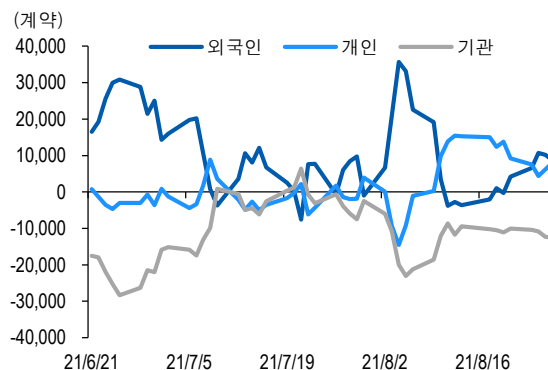
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



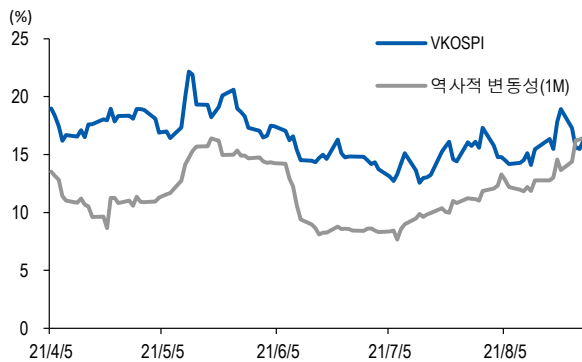
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	777,071	237.0	892,776	13.8%	지수옵션 전체	1,789,963	573.2	2,439,099
Put	1,012,892	336.3	1,546,323	16.2%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	16.15%(+0.67%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	0.88	-0.55	90,704	22,234	1,393	13.6	Put	417.5(K+1)	9.07	2.01	4,092	3,519	40	14.3
	420.0(K+2)	1.39	-0.75	96,661	22,124	-173	13.9		415.0(K+0)	7.48	1.77	7,645	10,527	198	14.7
	417.5(K+1)	2.07	-1.01	65,842	12,665	150	14.3		412.5(K-1)	6.15	1.55	16,330	5,951	401	15.3
	415.0(K+0)	2.97	-1.22	34,534	15,886	250	14.7		410.0(K-2)	4.95	1.29	25,313	16,526	-194	15.7
	412.5(K-1)	4.07	-1.51	16,313	10,064	99	15.0		407.5(K-3)	4.00	1.10	40,146	8,898	906	16.2

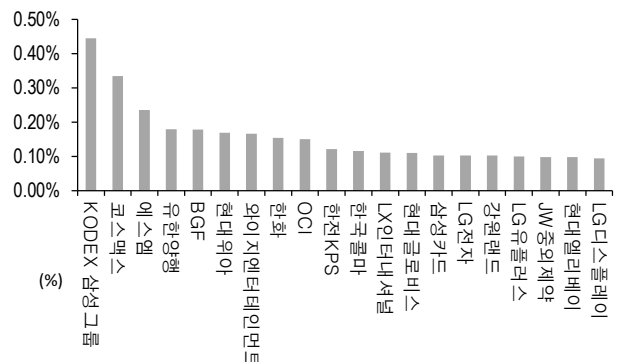
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,649,794	3,830.3	5,879,583	50,228	-54,477	41,113	17,663	-14.5	33.9	-13.4			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,700	0.00	68.7	122.7	107,185	-29,999	-0.02%	-10,078	6,009	4,413	9,392	-287
현대제철	48,250	-0.21	22.3	103.0	25,405	-567	0.00%	-1	-632	495	402	503
삼성전자	74,800	-1.06	1,257.8	100.6	1,149,254	4,959	0.02%	-1,692	10,633	-8,951	7,508	-11,804
현대차	210,000	0.24	77.1	88.1	61,476	-209	-0.03%	930	-607	-326	532	-411
현대건설	52,500	1.35	27.8	83.1	26,633	2,536	0.07%	-1,222	-550	2,039	-1,882	1,767
두산밥캣	42,050	-1.06	7.4	79.6	40,079	-1,861	-0.15%	-2,977	4,739	-2,261	-931	63
KT	32,800	0.00	16.9	77.0	57,403	-4,980	-0.06%	-4,234	-1,835	6,069	6,072	-3
현대모비스	267,000	1.14	56.0	73.4	11,941	1,812	-0.11%	1,882	-2,176	774	433	340
SK 하이닉스	104,000	0.48	281.4	72.8	156,313	6,897	-0.07%	1,643	-514	-1,106	-9,426	0
삼성 SDI	763,000	-1.80	112.1	67.5	30,969	668	0.01%	-277	1,019	-743	95	-268

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터