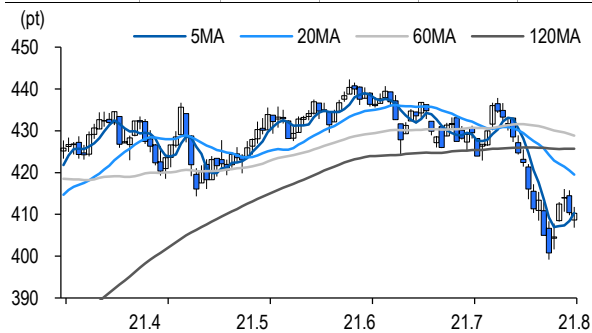


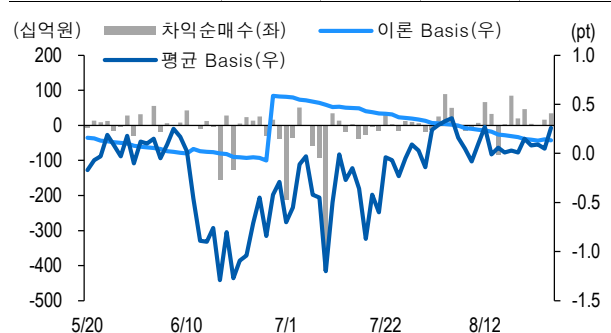
선물옵션시장 지표

2021.8.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	410.24	-0.03	-0.14	7,832.8	-
선물 9월물	410.60	0.02	0.10	28,675.5	257,106
선물 12월물	410.25	0.04	0.15	145.5	33,516
9월물(mini)	410.50	0.00	0.00	2,134.9	51,591
10월물(mini)	410.00	-0.08	-0.32	4.8	1,037



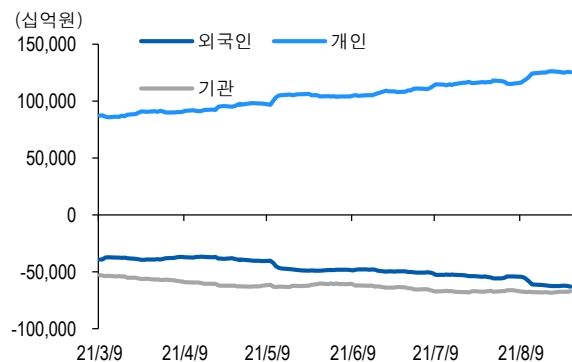
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.13	0.26	0.36	0.03%
베이스(mini)	0.13	0.26	0.26	0.03%
제1스프레드(SP)	0.35	-0.27	-0.25	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	0.36	0.36	0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-370.6	14.0	-356.6	0.0	-68.2	363.5	19.5	-2.5	-0.3	37.9
개인	-344.1	29.6	-314.4	0.0	1.8	-168.9	-12.9	0.3	2.3	4.4
기관	731.8	-45.4	686.4	34.4	51.2	-175.4	-11.7	2.3	-2.3	-41.7
금융투자	628.8	-78.5	550.3	34.5	32.9	-148.3	-11.7	2.3	-2.4	-13.7
투신	22.7	1.3	24.0	4.1	-25.7	-12.9	0.0	0.0	0.2	-15.6
은행+보험+기타금융	29.6	41.7	71.3	0.0	25.6	-19.8	0.0	0.0	0.0	0.5
연기금+국가지자체	22.5	-1.6	20.9	-4.2	-0.4	5.5	-0.1	0.0	0.0	-13.0
기타법인	-17.1	1.7	-15.3	0.0	1.1	-19.2	5.2	-0.1	0.4	-0.6

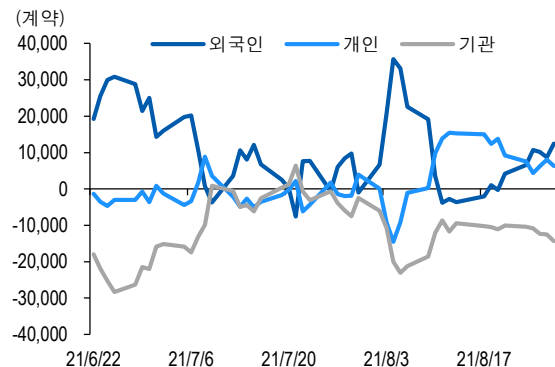
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



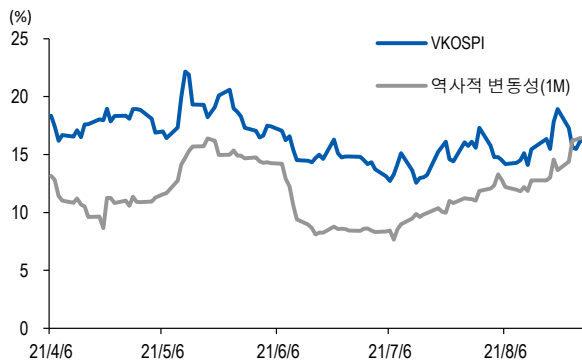
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	867,706	246.0	916,483	14.6%	지수옵션 전체	1,880,311	564.5	2,511,849
Put	1,012,605	318.5	1,595,366	16.8%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	16.17%(+0.02%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	417.5(K+3)	1.95	-0.12	79,403	15,218	2,553	14.4	Put	412.5(K+1)	5.85	-0.30	3,897	6,024	73	14.7
	415.0(K+2)	2.84	-0.13	75,232	16,240	354	14.9		410.0(K+0)	4.70	-0.25	14,407	17,813	1,287	15.3
	412.5(K+1)	3.96	-0.11	30,399	10,318	254	15.4		407.5(K-1)	3.76	-0.24	21,542	8,721	-177	15.9
	410.0(K+0)	5.30	-0.12	18,379	12,125	1,254	15.9		405.0(K-2)	3.00	-0.22	44,203	16,685	955	16.5
	407.5(K-1)	6.86	-0.09	5,634	3,800	489	16.6		402.5(K-3)	2.35	-0.21	53,363	9,730	644	17.0

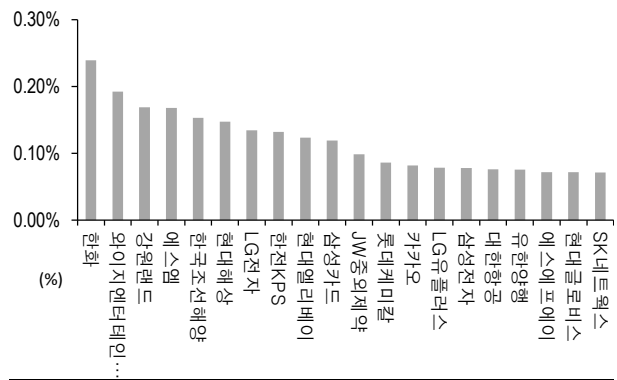
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균배이스 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	3,656,498	3,150.2	5,986,907	107,324	102,090	14,720	-110,086	37.9	4.4	-41.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대제철	48,400	0.31	19.8	112.2	25,120	-285	0.01%	1,089	-498	-640	-1,998	1,358
두산밥캣	42,050	0.00	7.2	103.6	38,574	-1,505	0.02%	2,360	1,356	-3,716	-3,669	-67
하나금융지주	45,000	0.67	35.8	95.1	106,344	-841	-0.05%	437	-1,003	607	538	-329
삼성 SDI	765,000	0.26	108.7	93.5	31,111	142	-0.03%	-31	-728	748	528	242
삼성전자	74,600	-0.27	1,044.5	93.2	1,185,549	36,295	0.08%	37,336	3,568	-41,022	-15,579	-22,290
현대건설	51,800	-1.33	15.4	70.1	25,734	-899	-0.06%	718	-159	-563	1,022	2,053
기아	82,200	0.00	41.7	69.5	43,510	-433	0.05%	306	-611	305	-2,531	-2,741
영진약품	5,380	-0.37	1.2	67.8	10,693	-487	-0.04%	344	183	-528	-532	4
SK 하이닉스	103,500	-0.48	235.3	65.9	144,584	-11,729	-0.09%	5,061	-7,012	2,050	13,978	-50
호텔신라	89,200	0.00	15.8	65.1	18,386	323	-0.08%	419	212	-644	124	793

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터