

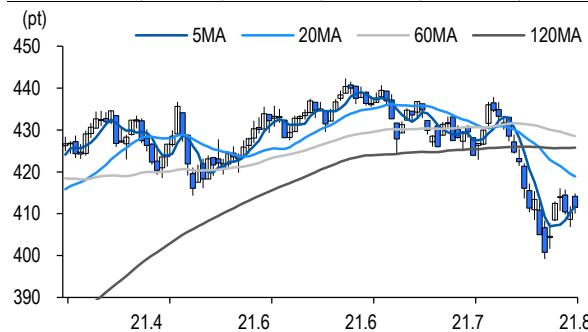


선물옵션시장 지표

2021.8.31

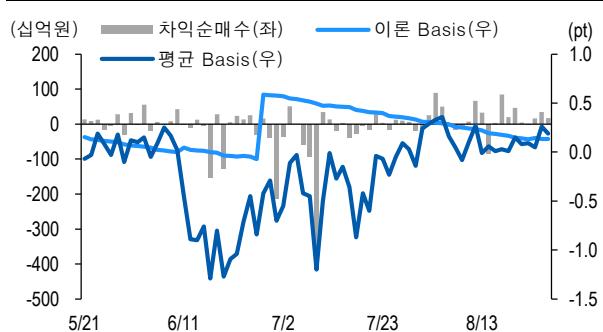
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	411.50	0.31	1.26	7,944.3	-
선물 9월물	411.90	0.32	1.30	25,349.0	259,553
선물 12월물	411.40	0.28	1.15	183.6	33,930
9월물(mini)	411.92	0.32	1.42	1,825.6	50,131
10월물(mini)	411.20	0.29	1.20	4.2	1,111



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.10	0.19	0.40	0.02%
베이시스(mini)	0.10	0.19	0.42	0.02%
제1스프레드(SP)	0.35	-0.25	-0.25	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.35	0.35	0.06%



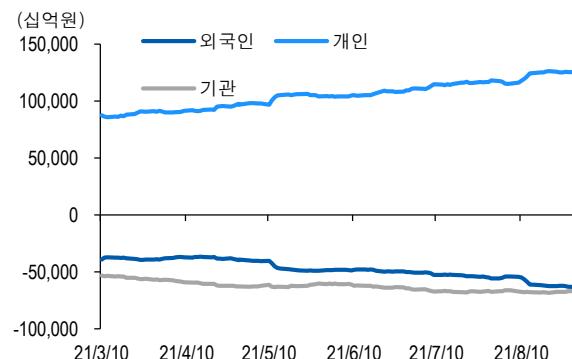
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-236.7	10.6	-226.1	0.0	-99.7	-57.5	-15.7	-0.5	2.2	-6.3
개인	-57.5	3.0	-54.6	0.0	0.1	-66.0	3.0	0.6	-2.0	38.4
기관	252.7	-24.5	228.3	17.3	30.5	186.6	2.4	0.0	-0.1	-18.4
금융투자	152.7	-30.8	121.9	9.5	6.0	185.2	2.5	0.8	-0.2	-36.2
투신	60.8	-5.7	55.1	4.1	14.0	70.3	-0.1	0.0	0.1	11.3
은행+보험+기타금융	2.1	12.5	14.6	0.0	-0.3	-74.9	0.0	-0.8	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-9.6	-2.4	-12.0	-4.1	1.4	5.9	0.0	0.0	0.0	6.5
기타법인	41.5	10.8	52.3	0.0	0.3	-63.0	10.3	-0.2	0.0	-13.6

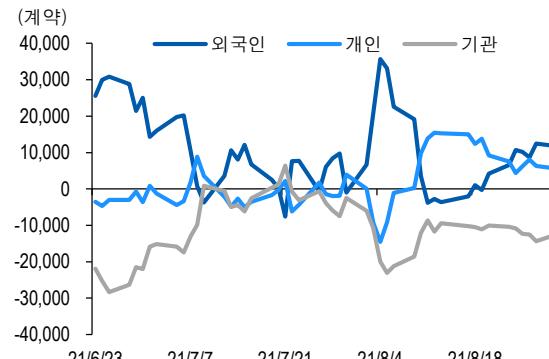
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	793,823	214.8	944,191	14.9%	지수옵션 전체	1,875,174	489.5	2,580,307
Put	1,081,351	274.7	1,636,116	16.7%	PCR(금액기준)	1.28	VKOSPI	15.88%(-0.29%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	417.5(K+3)	1.97	0.02	71,494	16,430	1,212	14.9	412.5(K+1)
	415.0(K+2)	2.88	0.04	48,640	16,552	312	15.3	410.0(K+0)
	412.5(K+1)	4.07	0.11	19,637	11,133	815	15.8	407.5(K-1)
	410.0(K+0)	5.50	0.20	7,258	12,442	317	16.3	405.0(K-2)
	407.5(K-1)	7.17	0.31	1,059	3,427	-373	17.1	402.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	412.5(K+1)	4.70	-1.15	11,883	6,451	427	14.9	410.0(K+0)
	410.0(K+0)	3.65	-1.05	29,980	18,882	1,069	15.5	407.5(K-1)
	407.5(K-1)	2.79	-0.97	45,520	9,238	517	16.1	405.0(K-2)
	405.0(K-2)	2.11	-0.89	85,356	19,124	2,439	16.6	402.5(K-3)
	402.5(K-3)	1.58	-0.77	65,768	10,612	882	17.1	

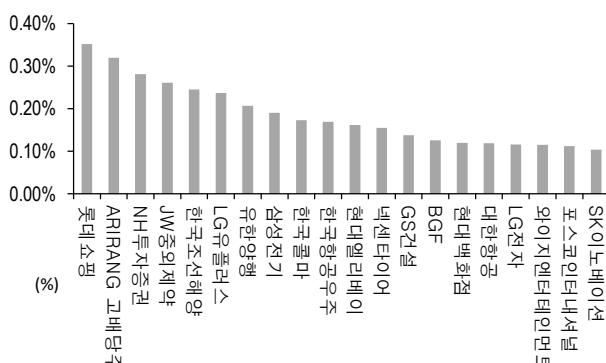
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,175,294	2,790.6	6,035,259	48,352	-44,692	55,151	6,241	-6.3	38.4	-18.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	74,700	0.13	828.6	87.8	1,185,515	-34	0.06%	1,238	9,265	-3,568
POSCO	332,000	5.23	149.6	74.6	21,015	4,032	0.03%	-267	2,945	-2,677
NAVER	427,500	1.91	126.0	74.2	81,540	131	0.01%	2,539	-1,110	-1,444
하나금융지주	43,700	-2.89	32.5	74.1	104,152	-2,192	0.05%	-1,817	3,514	-1,860
롯데케미칼	247,500	1.85	27.5	65.3	9,028	183	0.06%	354	4	-358
셀트리온	291,000	-0.85	133.5	58.5	36,000	-1,760	-0.07%	-699	-1,266	2,035
아모레퍼시픽	222,000	-1.55	19.5	58.4	12,269	771	-0.19%	391	239	-630
SK 하이닉스	104,000	0.48	108.4	58.1	137,560	-7,024	-0.06%	-6,110	622	9,530
SK 이노베이션	241,000	0.63	35.6	56.7	23,481	-521	0.10%	-408	222	156
삼성전기	179,000	0.00	34.1	56.6	25,982	1,781	0.19%	-749	573	171

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터