

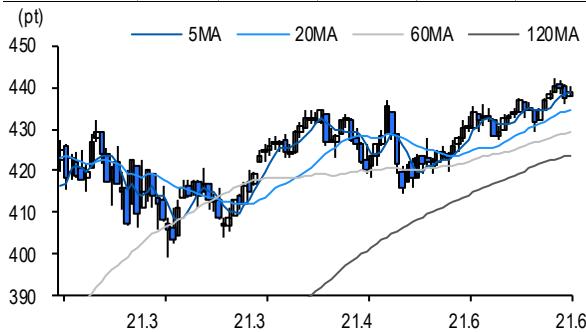


선물옵션시장 지표

2021.7.1

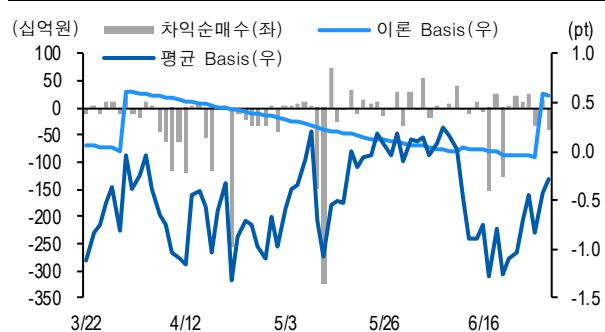
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	438.84	0.30	1.30	9,536.1	-
선물 9월물	438.85	0.41	1.80	14,367.5	233,750
선물 12월물	438.30	0.37	1.60	7.7	28,509
7월물(mini)	438.72	0.40	1.74	1,593.2	64,867
8월물(mini)	438.70	0.41	1.80	5.0	903



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.58	-0.29	0.01	-0.20%
베이시스(mini)	0.07	-0.41	-0.12	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.35	-0.35	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	-0.12	-0.12	-0.04%



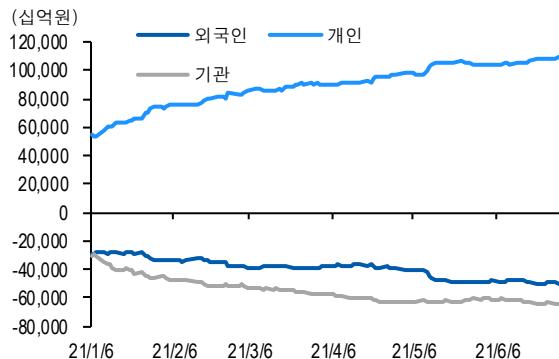
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-12.6	20.9	8.2	-7.9	0.4	362.9	32.0	0.8	-1.3	12.0
개인	31.5	-47.0	-15.4	0.0	-3.4	-255.7	-68.0	0.0	-0.4	94.5
기관	-51.9	28.1	-23.8	-31.2	9.2	-99.8	48.8	-0.9	1.7	-109.3
금융투자	-46.0	70.2	24.2	-2.7	-13.6	-465.2	35.8	-0.8	1.4	-90.1
투신	23.6	1.8	25.4	0.0	9.3	354.2	-0.9	-0.1	0.0	-3.5
은행+보험+기타금융	8.4	-40.2	-31.9	0.0	-2.9	-11.3	13.8	0.0	0.3	-0.2
연기금+국가지자체	32.4	0.6	33.1	-28.5	30.8	22.6	0.0	0.0	0.0	-15.5
기타법인	33.0	-2.0	31.0	0.0	0.3	-7.3	-12.8	0.1	-0.1	2.9

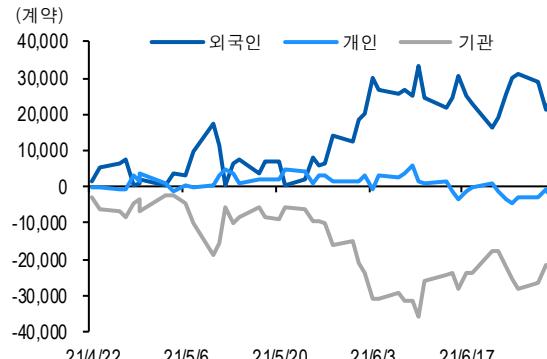
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



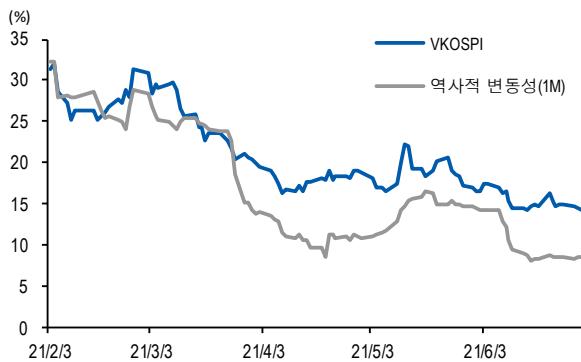
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	610,423	169.6	676,947	11.2%	지수옵션 전체	1,159,451	282.0	1,865,003
Put	549,028	112.5	1,188,056	13.0%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	14.17%(-0.35%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	445.0(K+3)	0.97	0.09	93,192	22,260	1,120	11.2	440.0(K+1)
	442.5(K+2)	1.64	0.22	72,219	20,640	-745	11.3	437.5(K+0)
	440.0(K+1)	2.58	0.38	66,017	18,342	425	11.2	435.0(K-1)
	437.5(K+0)	3.90	0.60	20,282	12,669	704	11.5	432.5(K-2)
	435.0(K-1)	5.55	0.84	5,041	11,771	602	11.8	430.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	440.0(K+1)	3.86	-1.37	12,736	5,558	1,379	11.9	440.0(K+1)
	437.5(K+0)	2.68	-1.15	32,334	10,678	2,891	12.2	437.5(K+0)
	435.0(K-1)	1.83	-0.90	47,950	12,244	2,089	12.6	435.0(K-1)
	432.5(K-2)	1.24	-0.67	55,054	14,304	2,798	13.1	432.5(K-2)
	430.0(K-3)	0.82	-0.49	65,762	19,688	522	13.5	430.0(K-3)

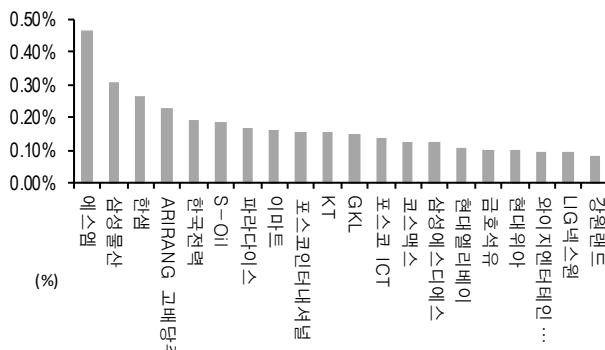
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,468,398	3,780.1	7,426,095	99,853	-45,351	35,427	9,688	12.0	94.5	-109.3
<hr/>										
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
NAVER	418,000	1.58	369.8	93.1	71,368	1,032	0.05%	-3,074	7,405	-4,832
기아	89,600	0.11	104.9	78.0	159,205	-5,029	0.03%	4,557	-1,570	-2,807
호텔신라	97,100	-0.21	19.4	75.5	39,575	-134	0.02%	145	580	-693
카카오	163,500	3.15	850.3	72.6	210,411	-42,037	0.00%	-9,418	25,854	-17,199
삼성SDI	700,000	1.16	156.4	66.4	34,738	1,904	0.05%	1,240	1,157	-2,398
POSCO	348,500	0.29	76.2	66.2	16,522	327	0.00%	700	-195	-501
삼성전자	80,900	0.00	607.4	61.5	1,313,144	-16,012	0.04%	15,271	-18,679	3,588
SK 이노베이션	296,500	4.96	208.5	54.5	30,566	4,179	0.06%	3,546	3,260	-6,770
LG 전자	163,500	1.87	93.9	51.6	50,958	-4,307	-0.14%	-1,011	2,503	-1,513
SK 하이닉스	127,500	2.00	281.2	50.7	196,953	9,854	0.05%	5,277	9,135	-14,517
<hr/>										

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터