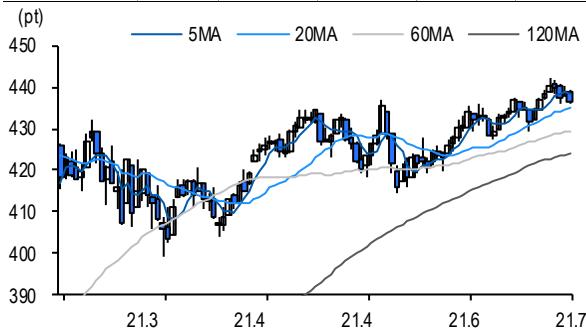


선물옵션시장 지표

2021.7.2

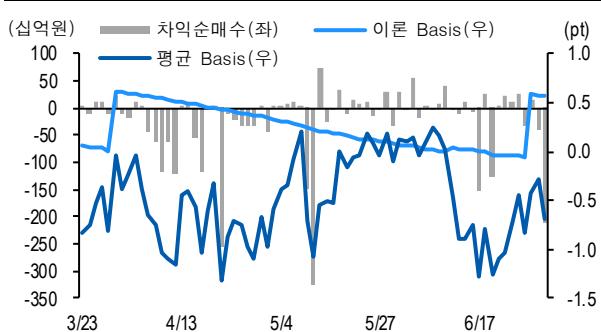
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 436.34 | -0.57 | -2.50 | 10,969.2 | - |
| 선물 9월물 | 435.90 | -0.67 | -2.95 | 15,862.5 | 236,523 |
| 선물 12월물 | 435.40 | -0.66 | -2.90 | 22.1 | 28,535 |
| 7월물(mini) | 435.90 | -0.64 | -2.82 | 1,655.1 | 65,049 |
| 8월물(mini) | 435.72 | -0.68 | -2.98 | 7.7 | 1,026 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.58 | -0.70 | -0.44 | -0.29% |
| 베이시스(mini) | 0.06 | -0.59 | -0.44 | -0.15% |
| 제1스프레드(SP) | 0.14 | -0.42 | -0.55 | -0.13% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | 0.06 | -0.43 | -0.43 | -0.11% |



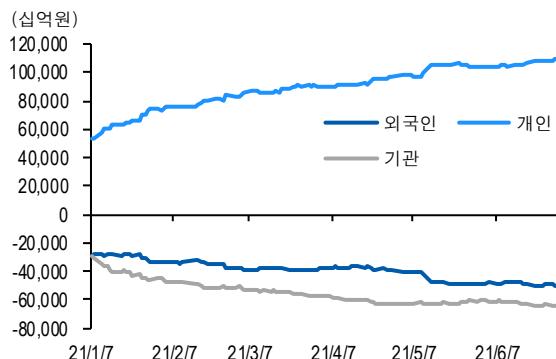
투자주체별 매매 동향

(십억원)

| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|---------|--------|-----------|--------|--------|----------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -407.3 | -26.4 | -433.7 | -85.8 | -233.5 | -1,151.3 | -27.2 | -0.3 | 0.8 | -11.0 |
| 개인 | 1,264.4 | 26.7 | 1,291.1 | 0.0 | -1.0 | 359.3 | 135.6 | -1.4 | 1.4 | -72.4 |
| 기관 | -871.9 | -2.7 | -874.7 | -125.6 | -136.6 | 795.4 | -122.6 | 2.4 | -2.4 | 84.1 |
| 금융투자 | -590.9 | -30.8 | -621.7 | -93.6 | -37.4 | 915.9 | -121.1 | 2.3 | -2.5 | 85.2 |
| 투신 | -51.8 | 6.3 | -45.6 | -3.5 | -19.2 | -155.2 | -1.6 | 0.1 | 0.0 | -40.4 |
| 은행+보험+기타금융 | 8.6 | 11.0 | 19.5 | 0.0 | 17.5 | 6.1 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 0.7 |
| 연기금+국가지자체 | -206.1 | -1.5 | -207.6 | -28.5 | -93.3 | 28.5 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 38.7 |
| 기타법인 | 14.9 | 2.4 | 17.2 | 0.0 | 0.0 | -3.4 | 14.2 | -0.6 | 0.3 | -0.7 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

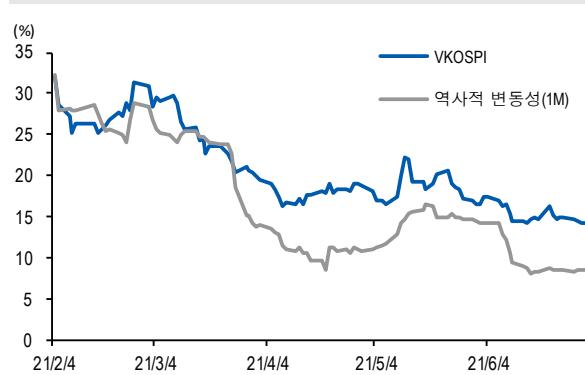




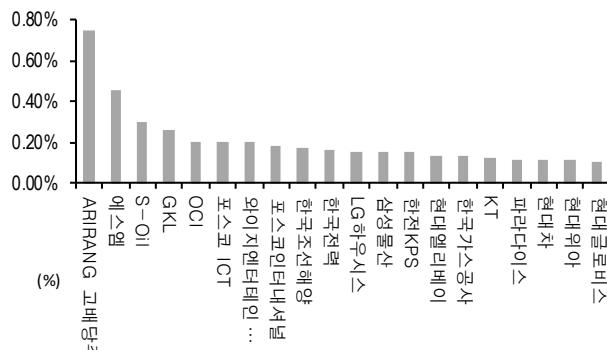
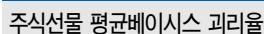
선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | (계약, 십억원) | | | | | | | |
|-----------|------------|-------|-----------|---------|-----------|-------|-----------|-----------|----------------|------|--------|--------|--------|-------|-------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | | | | | | |
| Call | 677,952 | 144.2 | 692,263 | 10.6% | 지수옵션 전체 | | 1,424,003 | 357.0 | 1,909,709 | | | | | | |
| Put | 746,051 | 212.7 | 1,217,446 | 12.7% | PCR(금액기준) | | 1.47 | VKOSPI | 14.33%(+0.16%) | | | | | | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내체변동성 | | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내체변동성 |
| Call | 447.5(K+3) | 0.17 | -0.38 | 79,993 | 22,647 | 3,554 | 10.7 | Put | 442.5(K+1) | 7.32 | 1.92 | 3,718 | 2,673 | 1,220 | 13.3 |
| | 445.0(K+2) | 0.36 | -0.61 | 106,738 | 26,625 | 4,365 | 10.6 | | 440.0(K+0) | 5.39 | 1.53 | 10,414 | 6,173 | 615 | 12.7 |
| | 442.5(K+1) | 0.71 | -0.93 | 94,919 | 23,910 | 3,270 | 10.6 | | 437.5(K-1) | 3.79 | 1.11 | 27,467 | 11,846 | 1,168 | 12.5 |
| | 440.0(K+0) | 1.30 | -1.28 | 101,807 | 21,262 | 2,920 | 10.5 | | 435.0(K-2) | 2.56 | 0.73 | 91,685 | 14,921 | 2,677 | 12.5 |
| | 437.5(K-1) | 2.18 | -1.72 | 50,627 | 15,652 | 2,983 | 10.4 | | 432.5(K-3) | 1.67 | 0.43 | 85,834 | 14,607 | 303 | 12.7 |

자료: KRX, 유안티증권 리서치센트



자료: KRX, 유안티증권 리서치센-



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

자료: KBX 유아티즈권 리서치센터