

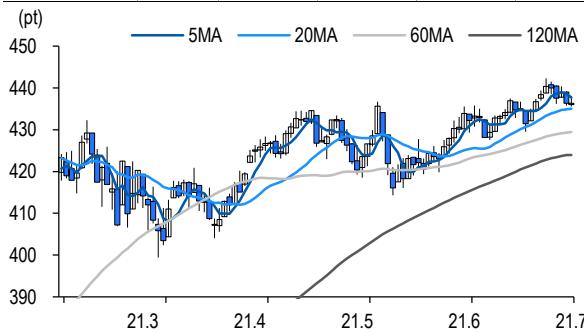


## 선물옵션시장 지표

2021.7.5

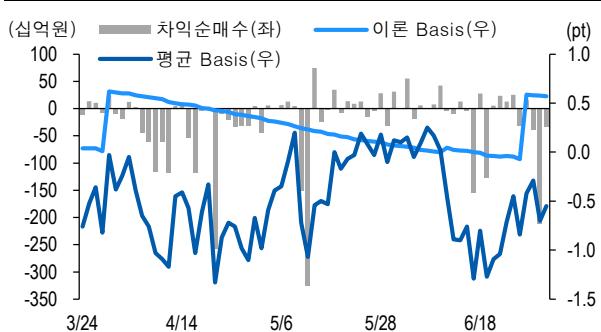
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.00	-0.08	-0.34	8,924.5	-
선물 9월물	435.70	-0.05	-0.20	14,445.5	235,925
선물 12월물	435.05	-0.08	-0.35	23.8	28,538
7월물(mini)	435.60	-0.07	-0.30	1,469.8	65,778
8월물(mini)	435.46	-0.06	-0.26	9.1	1,941



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.57	-0.55	-0.30	-0.26%
베이시스(mini)	0.05	-0.51	-0.40	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.54	-0.45	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	-0.43	-0.43	-0.11%



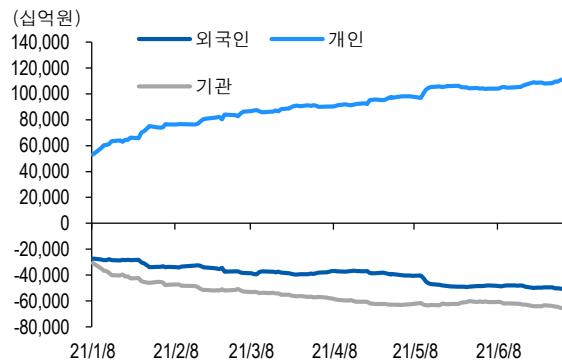
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

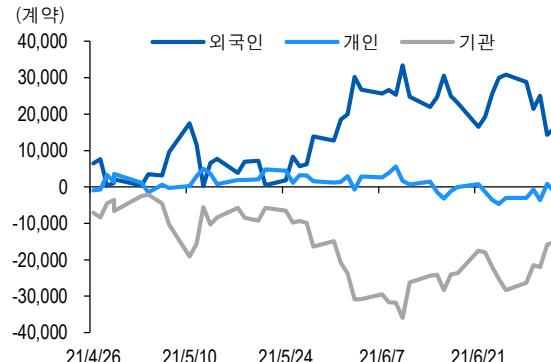
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-127.4	-12.2	-139.6	-17.5	43.3	190.4	-8.8	3.7	2.3	-24.1
개인	354.2	43.2	397.4	0.0	5.9	-198.6	-33.6	-2.8	-1.4	32.6
기관	-228.0	-32.2	-260.1	-17.3	-21.6	24.1	46.2	0.4	0.1	-7.3
금융투자	-98.7	-53.3	-151.9	-21.7	-13.0	-90.3	46.0	-0.8	1.5	35.3
투신	10.5	3.2	13.7	0.0	24.7	139.9	0.0	-0.3	0.0	-62.0
은행+보험+기타금융	-13.7	14.9	1.2	0.0	-3.2	-40.7	0.1	1.5	-1.4	2.7
연기금+국가지자체	-75.9	0.1	-75.8	4.4	-16.5	15.3	0.0	0.0	0.0	16.6
기타법인	1.2	1.2	2.3	0.0	0.3	-15.9	-3.7	-1.4	-1.0	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

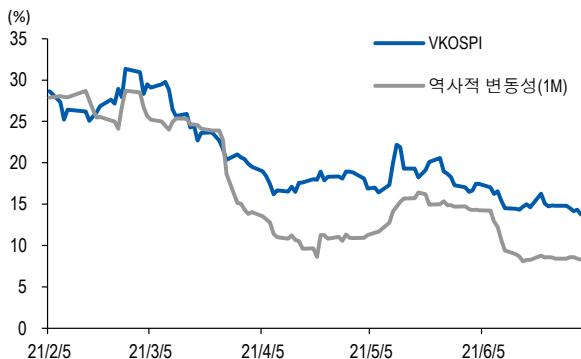
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)								
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	919,085	187.6	725,343	9.4%	지수옵션 전체	1,876,853	379.4	1,986,202
Put	957,768	191.9	1,260,859	12.0%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	13.74%(-0.59%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	445.0(K+3)	0.14	-0.22	149,642	32,299	5,674	9.3	440.0(K+1)
	442.5(K+2)	0.37	-0.34	155,816	27,863	3,953	9.4	437.5(K+0)
	440.0(K+1)	0.82	-0.48	176,034	23,128	1,866	9.4	435.0(K-1)
	437.5(K+0)	1.57	-0.61	115,408	18,292	2,640	9.2	432.5(K-2)
	435.0(K-1)	2.84	-0.61	30,324	13,431	629	9.4	430.0(K-3)
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	440.0(K+1)	5.22	-0.17	8,016	5,662	-511	11.7	
	437.5(K+0)	3.50	-0.29	35,802	12,732	886	11.3	
	435.0(K-1)	2.23	-0.33	85,462	16,493	1,572	11.3	
	432.5(K-2)	1.40	-0.27	103,183	18,340	3,733	11.8	
	430.0(K-3)	0.86	-0.20	171,824	27,906	4,209	12.3	

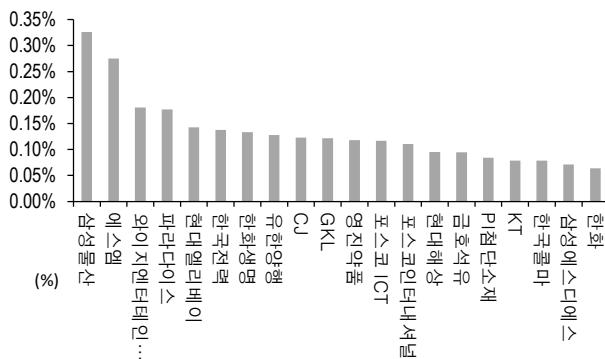
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	3,237,970	3,076.2	7,348,612	61,327	9,031	29,413	-35,487	-24.1	32.6	-7.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
호텔신라	95,900	0.00	28.1	117.8	36,959	-1,563	0.01%	860	-1,989	1,129
NAVER	413,500	0.12	173.6	81.2	55,822	-9,953	0.01%	1,726	-1,128	-558
카카오	159,500	-0.62	499.2	71.5	200,311	-6,803	-0.02%	2,870	6,389	-9,101
현대차	239,000	-1.85	133.0	67.2	83,304	-7,877	-0.15%	-4,839	2,841	1,998
하나금융지주	45,300	-0.11	15.3	66.1	109,070	-9,157	-0.01%	-2,409	-24	2,432
삼성SDI	724,000	0.00	150.1	62.7	36,090	-626	0.06%	-1,364	1,035	345
기아	89,900	-0.88	139.1	59.8	132,598	-8,305	0.02%	-5,639	-8,250	13,889
삼성전기	178,000	0.56	22.1	52.2	23,821	-466	0.04%	-30	-1,347	1,518
LG화학	847,000	0.24	58.2	52.0	16,639	-189	0.01%	-481	-328	809
CJ제일제당	448,500	-1.21	8.9	50.9	1,452	-878	-0.31%	29	18	-47

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터