

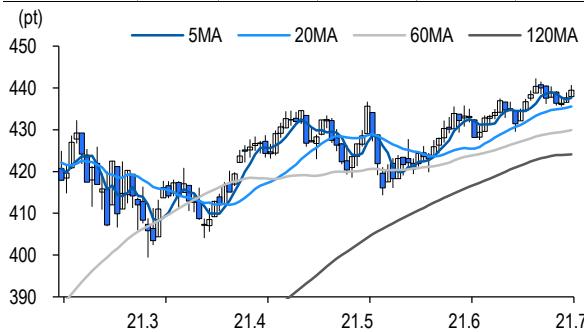


선물옵션시장 지표

2021.7.7

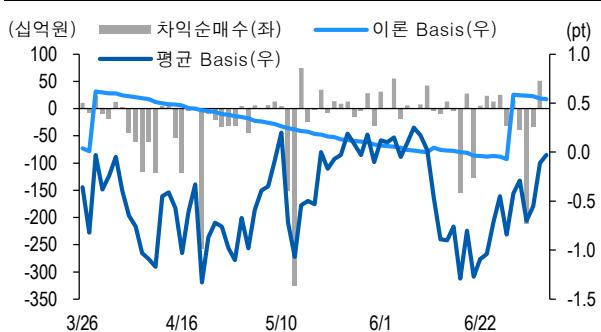
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	439.50	0.42	1.84	9,629.8	-
선물 9월물	439.15	0.21	0.90	15,469.2	235,285
선물 12월물	438.70	0.27	1.20	14.6	28,567
7월물(mini)	439.20	0.24	1.06	1,500.3	65,830
8월물(mini)	439.34	0.33	1.46	43.3	9,219



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.54	-0.03	-0.35	-0.13%
베이시스(mini)	0.02	-0.07	-0.30	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.40	-0.40	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.02	-0.26	-0.26	-0.06%



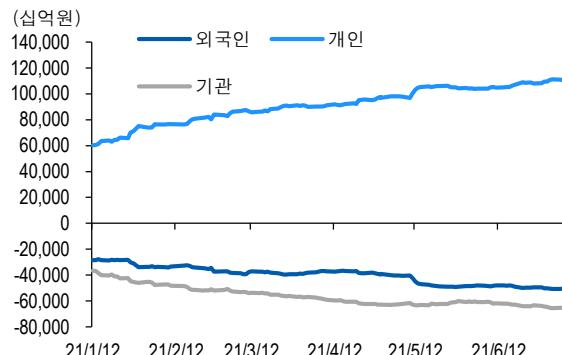
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	223.7	16.1	239.9	0.0	45.6	49.9	-2.4	3.1	-0.8	-39.8
개인	-292.6	23.8	-268.8	0.0	-0.5	113.8	5.3	0.5	-3.1	45.6
기관	69.6	-38.7	30.9	0.9	-43.8	-180.4	4.8	-3.1	4.3	-8.8
금융투자	139.9	32.6	172.5	3.1	-3.3	-42.6	2.3	-3.3	4.2	-41.3
투신	25.7	-12.1	13.7	0.0	1.6	-106.5	2.9	-0.1	0.0	25.2
은행+보험+기타금융	-10.8	-47.8	-58.6	0.0	-10.8	-11.5	-0.3	0.2	0.1	1.5
연기금+국가지자체	-96.5	-18.4	-114.8	-2.1	-30.7	-19.8	-0.1	0.0	0.0	5.8
기타법인	-0.7	-1.2	-1.9	0.0	0.3	16.7	-7.7	-0.5	-0.3	2.9

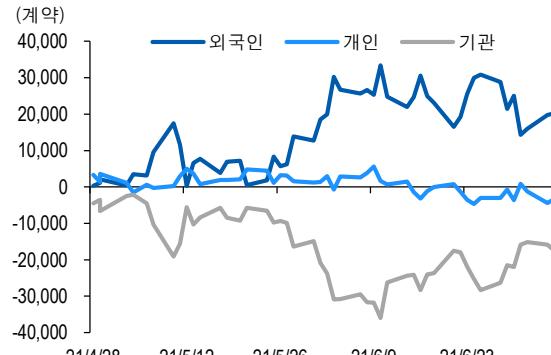
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,086,881	228.0	783,611	10.0%	지수옵션 전체	2,098,865	388.3	2,152,193
Put	1,011,984	160.3	1,368,582	12.4%	PCR(금액기준)	0.70	VKOSPI	12.71%(-0.40%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	445.0(K+3)	0.18	0.01	243,285	37,125	1,790	10.3	440.0(K+1)
	442.5(K+2)	0.53	0.08	237,113	30,414	627	10.0	437.5(K+0)
	440.0(K+1)	1.32	0.23	234,132	23,784	1,106	9.7	435.0(K-1)
	437.5(K+0)	2.72	0.43	67,882	17,571	-421	9.4	432.5(K-2)
	435.0(K-1)	4.64	0.66	14,394	13,123	-193	8.1	430.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	440.0(K+1)	2.09	-0.91	99,545	14,579	7,839	11.6	440.0(K+1)
	437.5(K+0)	0.98	-0.70	164,745	17,210	398	11.4	437.5(K+0)
	435.0(K-1)	0.42	-0.46	194,121	28,280	9,072	11.9	435.0(K-1)
	432.5(K-2)	0.19	-0.26	163,464	26,835	3,449	12.8	432.5(K-2)
	430.0(K-3)	0.09	-0.15	99,922	37,403	3,860	13.9	430.0(K-3)

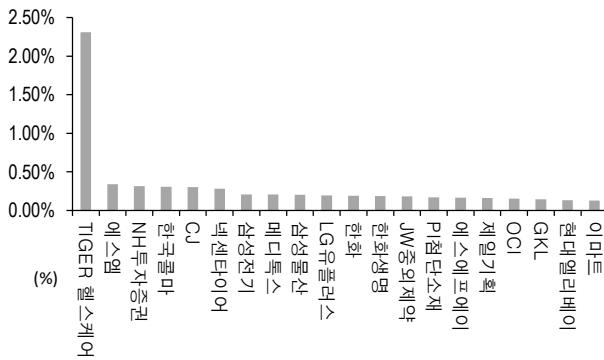
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,398,003	3,837.0	7,482,654	134,140	-44,896	53,616	-10,442	-39.8	45.6	-8.8
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	81,100	0.87	801.4	81.7	871,194	-232,035	0.05%	326	49,769	-52,404
호텔신라	97,100	1.46	30.5	77.1	33,392	-1,761	-0.05%	1,412	-1,782	175
하나금융지주	45,050	0.22	14.3	72.1	95,541	-5,570	-0.14%	-1,977	-58	1,825
삼성 SDI	748,000	3.31	210.2	70.1	26,306	-2,551	0.07%	112	-173	15
NAVER	409,500	-0.12	96.0	68.4	27,741	-1,674	0.02%	455	-357	-100
SK 하이닉스	125,000	1.21	167.3	64.8	139,595	-9,726	-0.27%	2,578	-4,711	2,130
LG 화학	873,000	0.23	85.5	63.1	11,609	-4,946	-0.02%	-2,149	72	2,076
카카오	158,000	0.64	179.3	56.1	185,973	-3,807	-0.03%	-1,157	-1,478	2,627
기아	88,700	-0.34	67.8	52.8	112,386	-10,875	0.04%	1,270	717	-1,987
삼성전기	185,500	-1.59	67.7	52.8	31,772	-3,522	0.21%	-4,199	2,422	1,775

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터