

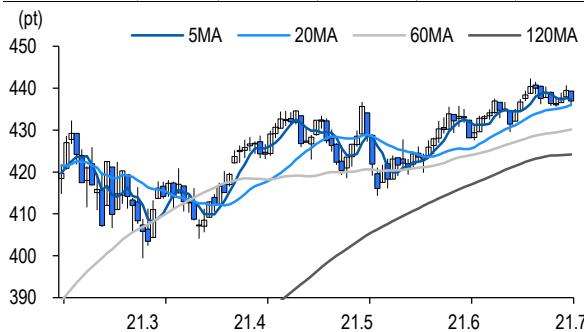


## 선물옵션시장 지표

2021.7.8

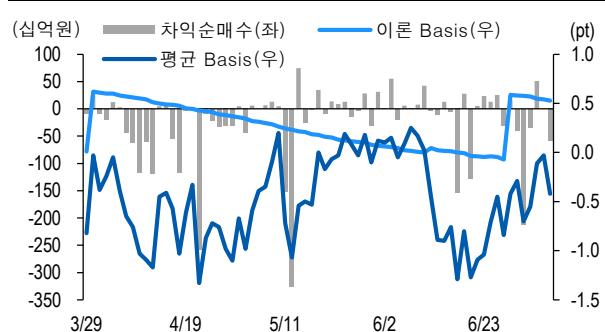
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.97	-0.58	-2.53	9,923.8	-
선물 9월물	436.45	-0.61	-2.70	18,976.4	235,191
선물 12월물	435.85	-0.65	-2.85	26.2	28,544
7월물(mini)	436.70	-0.57	-2.50	1,874.1	61,412
8월물(mini)	436.48	-0.65	-2.86	54.9	11,533



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.53	-0.42	-0.52	-0.22%
베이시스(mini)	0.01	-0.19	-0.27	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.45	-0.45	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.01	-0.30	-0.30	-0.07%



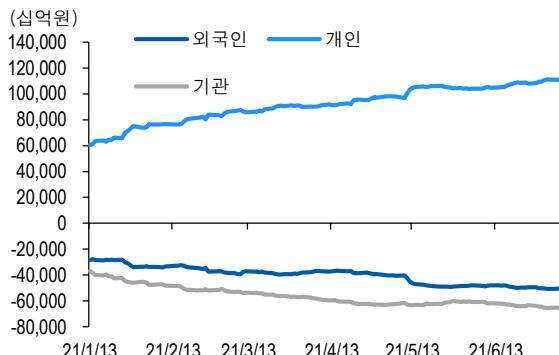
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-340.2	-9.6	-349.8	-1.0	-230.7	-1,104.1	63.8	1.1	0.3	-2.9
개인	1,165.7	-11.8	1,154.0	0.0	-9.9	513.5	44.2	-1.4	0.1	-61.5
기관	-835.0	20.7	-814.4	-57.9	-95.9	596.7	-126.3	0.8	-0.4	64.1
금융투자	-401.7	49.1	-352.5	-29.2	-18.4	682.0	-125.2	1.1	-0.4	64.8
투신	-75.0	41.5	-33.4	0.0	-18.9	-148.1	0.0	-0.3	0.0	-48.1
은행+보험+기타금융	-24.4	-78.2	-102.6	0.0	-5.6	10.1	-1.1	0.0	0.0	-0.5
연기금+국가지자체	-197.6	0.1	-197.5	-28.6	-36.3	52.6	0.0	0.0	0.0	48.0
기타법인	9.5	0.7	10.3	0.0	-0.7	-6.1	18.3	-0.5	0.1	0.3

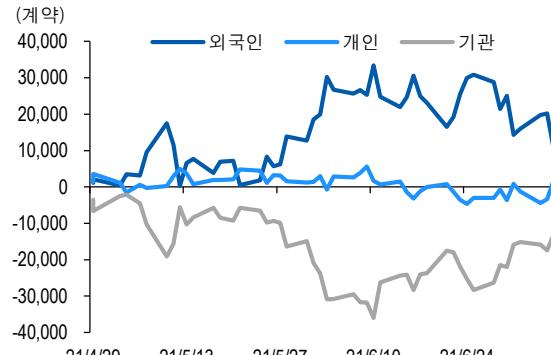
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,072,407	176.4	847,750	9.0%	지수옵션 전체	2,752,627	446.7	2,300,637
Put	1,680,220	270.3	1,452,887	12.4%	PCR(금액기준)	1.53	VKOSPI	13.29% (+0.58%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	447.5(K+3)	0.01	-0.05	62,443	32,143	3,786	13.1	442.5(K+1)
	445.0(K+2)	0.02	-0.16	102,920	39,859	2,734	11.3	440.0(K+0)
	442.5(K+1)	0.03	-0.50	170,738	39,455	9,041	8.8	437.5(K-1)
	440.0(K+0)	0.18	-1.14	297,815	42,124	18,340	8.3	435.0(K-2)
	437.5(K-1)	0.86	-1.86	242,143	24,602	7,031	8.5	432.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	442.5(K+1)	5.83	2.04	3,181	2,566	-474	15.0	440.0(K+0)
	440.0(K+0)	3.51	1.42	41,278	13,472	-1,107	12.1	437.5(K-1)
	437.5(K-1)	1.67	0.69	150,512	16,732	-478	10.8	435.0(K-2)
	435.0(K-2)	0.68	0.26	326,673	26,644	-1,636	11.4	432.5(K-3)
	432.5(K-3)	0.27	0.08	395,150	34,145	7,310	12.5	

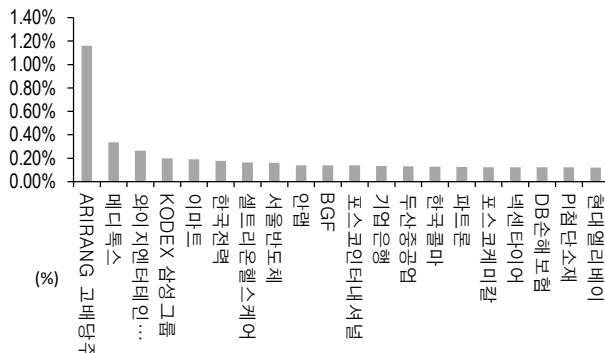
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	4,688,279	4,507.1	7,388,562	-94,092	20,556	-94,911	74,431	-2.9	-61.5	64.1
<hr/>										
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
NAVER	417,000	1.83	227.7	83.1	24,821	-2,920	0.02%	2,330	57	-2,379
삼성전자	80,700	-0.49	1,022.8	80.4	633,676	-237,518	-0.03%	-16,794	-51,526	66,835
삼성 SDI	750,000	0.27	200.4	77.8	12,714	-13,592	-0.03%	-2,613	1,157	1,357
SK 텔레콤	313,500	-1.26	39.9	77.1	7,427	-1,289	-0.06%	935	60	-989
KT	32,500	0.15	24.2	72.3	43,134	-23,388	0.04%	881	-2,308	1,432
LG 화학	863,000	-1.15	75.8	62.7	4,129	-7,480	-0.19%	-1,026	190	831
하나금융지주	44,000	-2.33	34.8	58.6	60,681	-34,860	-0.13%	1,033	-82	-1,492
SK 하이닉스	123,000	-1.60	158.3	58.1	123,445	-16,150	-0.13%	2,240	-1,665	-572
SK 이노베이션	271,500	-1.81	90.7	57.4	17,365	-9,545	-0.09%	-3,657	-548	4,263
카카오	161,500	2.22	400.3	56.5	149,265	-36,708	0.09%	-230	3,615	-3,379

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터