

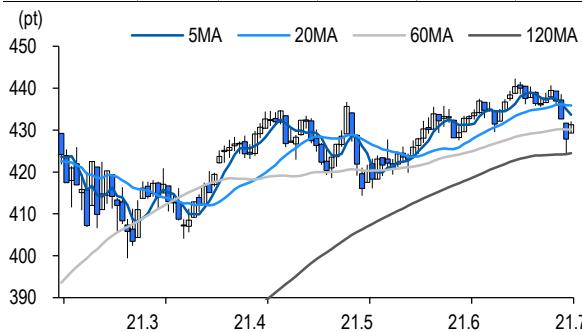


## 선물옵션시장 지표

2021.7.13

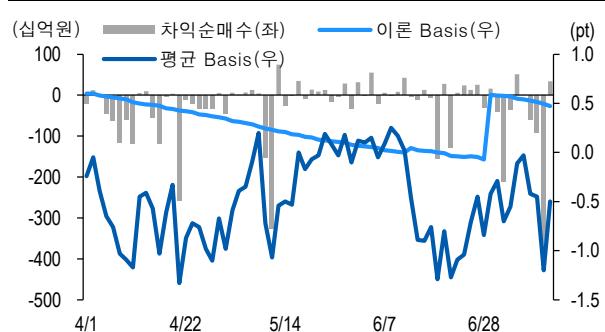
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.28	0.80	3.44	7,111.9	-
선물 9월물	431.50	1.23	5.25	18,159.8	243,909
선물 12월물	430.80	1.20	5.10	23.7	28,964
8월물(mini)	431.60	1.20	5.10	1,763.1	37,503
9월물(mini)	431.20	1.16	5.10	3.2	3,980



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.47	-0.50	0.22	-0.23%
베이시스(mini)	0.25	-0.47	0.32	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.59	-0.60	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.25	0.25	0.25	0.00%



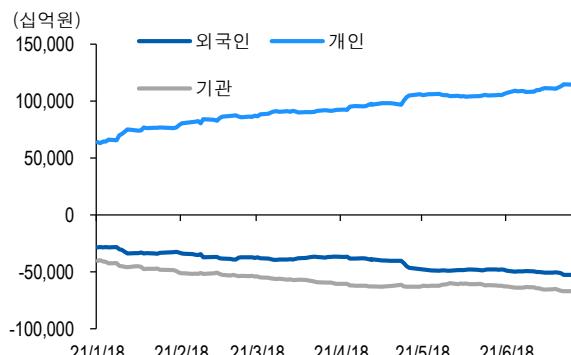
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

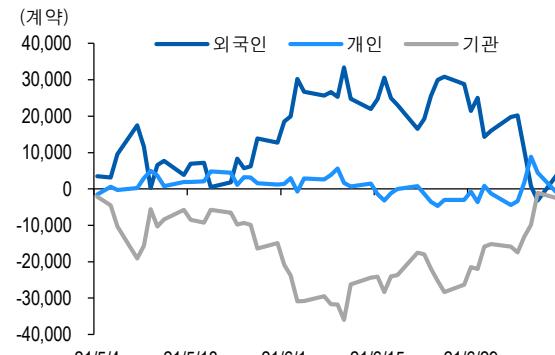
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	38.2	-32.6	5.6	0.0	72.9	826.6	-44.9	3.7	1.4	-24.8
개인	-228.9	16.0	-212.9	0.0	8.2	-551.4	-65.8	-2.5	-1.2	1.7
기관	218.7	17.8	236.6	34.1	16.9	-272.4	114.7	0.2	0.6	23.4
금융투자	137.5	33.3	170.8	-13.4	-1.1	-684.1	114.7	0.3	1.4	46.2
투신	30.2	-1.5	28.8	0.0	5.2	446.4	0.0	-0.4	-0.1	40.9
은행+보험+기타금융	-9.5	-16.4	-25.9	0.0	-3.4	7.5	0.0	0.3	-0.7	3.9
연기금+국가지자체	49.7	-9.4	40.3	47.5	17.8	-42.1	0.0	0.0	0.0	-67.6
기타법인	-28.0	-1.3	-29.3	0.0	-0.4	-2.8	-4.1	-1.4	-0.9	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	321,750	130.5	534,649	12.1%	지수옵션 전체	771,796	265.5	1,497,339
Put	450,046	135.1	962,690	13.4%	PCR(금액기준)	1.04	VKOSPI	13.62%(-1.50%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	4.58	1.11	10,325	6,952	1,451	12.0	Put	430.0(K+1)	5.59	-3.41	7,319	4,944	247	12.4
	432.5(K+2)	5.79	1.42	4,891	3,299	342	12.3		427.5(K+0)	4.67	-3.07	2,910	2,169	245	12.8
	430.0(K+1)	7.16	1.70	6,652	3,304	458	12.5		425.0(K-1)	3.84	-2.78	6,920	7,824	921	13.1
	427.5(K+0)	8.70	2.02	2,570	1,334	62	12.8		422.5(K-2)	3.17	-2.48	8,728	3,418	136	13.4
	425.0(K-1)	10.40	2.36	1,464	1,803	114	13.1		420.0(K-3)	2.67	-2.15	19,152	10,733	2,544	13.9

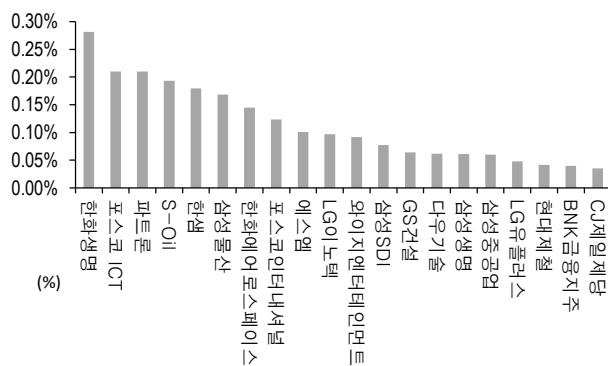
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,978,453	2,823.7	5,870,806	39,326	-4,805	-18,951	28,793	-24.8	1.7	23.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	419,000	0.72	218.3	110.5	84,310	-890	-0.04%	-53	-336	389	1,599	104
삼성 SDI	731,000	-0.68	176.3	106.5	37,064	2,645	0.08%	-1,326	1,607	-267	-116	-2,997
LG 이노텍	228,500	0.22	18.5	85.3	12,319	2,160	0.10%	-1,845	2,811	-964	-466	-543
카카오	163,000	1.88	430.5	82.9	182,273	2,648	-0.09%	2,981	3,206	-6,187	709	-7,180
호텔신라	93,500	1.08	15.8	82.6	22,562	1,621	0.01%	194	-862	669	1,460	-791
기아	87,900	1.97	108.0	80.4	108,311	1,472	0.01%	2,677	-2,193	-489	4,900	-7,362
KT	32,650	1.08	15.6	80.2	90,629	1,899	-0.01%	1,217	357	-1,566	2,611	-4,177
하나금융지주	43,150	1.89	43.2	76.2	148,255	2,898	0.00%	3,553	-525	-2,716	-3,484	-3,486
삼성전기	187,500	2.46	67.6	63.6	40,655	2,646	0.03%	115	2,326	-2,439	-39	-2,658
삼성전자	79,700	0.38	472.5	60.9	1,109,211	-11,308	-0.15%	-13,241	-4,956	18,128	15,142	2,700

---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터