

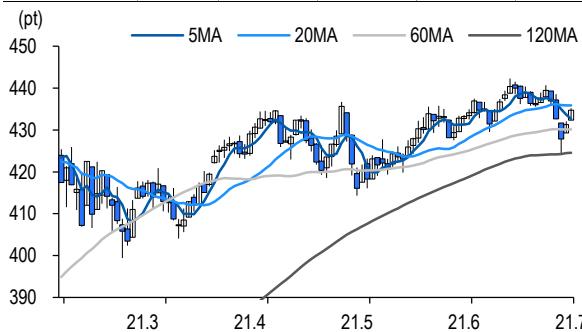


## 선물옵션시장 지표

2021.7.14

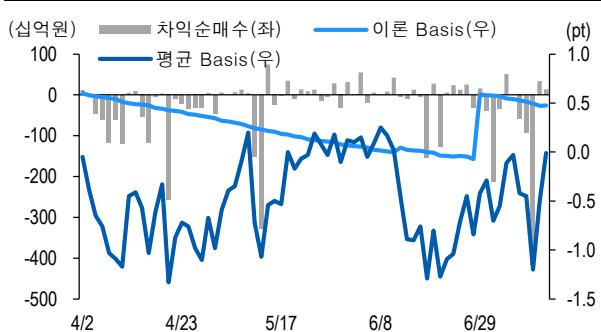
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.71	0.80	3.43	7,999.0	-
선물 9월물	434.60	0.72	3.10	13,838.3	239,272
선물 12월물	434.05	0.75	3.25	17.3	28,976
8월물(mini)	434.54	0.68	2.94	1,443.9	38,310
9월물(mini)	434.58	0.71	3.38	3.4	4,515



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.48	-0.01	-0.11	-0.11%
베이시스(mini)	0.25	-0.07	-0.17	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.62	-0.60	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.25	-0.13	-0.13	-0.09%



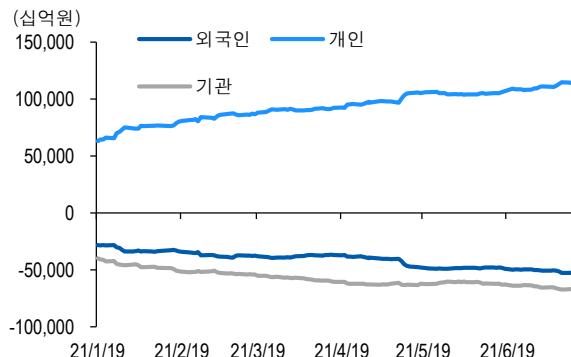
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	264.4	8.9	273.4	0.4	314.0	721.2	44.3	-3.9	1.9	73.3
개인	-562.4	6.3	-556.1	0.0	-25.3	-217.8	-73.7	1.9	-1.8	7.2
기관	306.7	-12.1	294.7	13.1	-67.9	-516.5	42.7	1.7	0.4	-82.5
금융투자	263.3	173.3	436.6	2.3	-40.9	-742.4	42.8	1.7	0.9	-89.6
투신	32.2	-6.6	25.6	0.0	27.2	230.7	-0.1	-0.1	0.1	55.9
은행+보험+기타금융	-4.1	-205.2	-209.4	0.0	-1.8	8.3	0.0	0.0	-0.5	0.2
연기금+국가지자체	44.2	-20.9	23.3	10.8	-19.1	-13.1	0.0	0.0	0.0	-49.0
기타법인	-8.7	-3.1	-11.9	0.0	-5.8	13.0	-13.3	0.3	-0.6	2.0

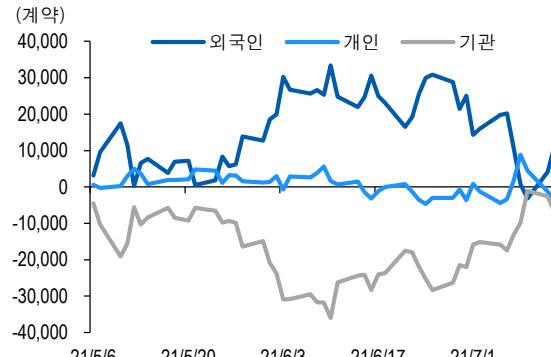
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	319,581	119.9	539,090	10.6%	지수옵션 전체		685,124	224.5	1,550,565
Put	365,543	104.6	1,011,475	12.5%	PCR(금액기준)		0.87	VKOSPI	12.55%(-1.07%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	440.0(K+3)	3.23	0.50	25,034	11,625	-472	10.6	435.0(K+1)	5.90
	437.5(K+2)	4.24	0.70	7,173	5,697	-23	10.7	432.5(K+0)	4.82
	435.0(K+1)	5.51	0.93	6,300	7,590	638	10.9	430.0(K-1)	3.94
	432.5(K+0)	6.90	1.11	4,785	3,185	-114	11.1	427.5(K-2)	3.18
	430.0(K-1)	8.49	1.33	2,376	3,453	149	11.3	425.0(K-3)	2.59
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	435.0(K+1)	5.90	-2.09	4,249	4,247	1,041	11.6	432.5(K+0)	4.82
	432.5(K+0)	4.82	-1.87	3,584	2,149	365	11.8	430.0(K-1)	3.94
	430.0(K-1)	3.94	-1.65	6,434	5,844	900	12.1	427.5(K-2)	3.18
	427.5(K-2)	3.18	-1.49	7,897	2,817	648	12.4	425.0(K-3)	2.59
	425.0(K-3)	2.59	-1.25	16,467	9,270	1,446	12.7		

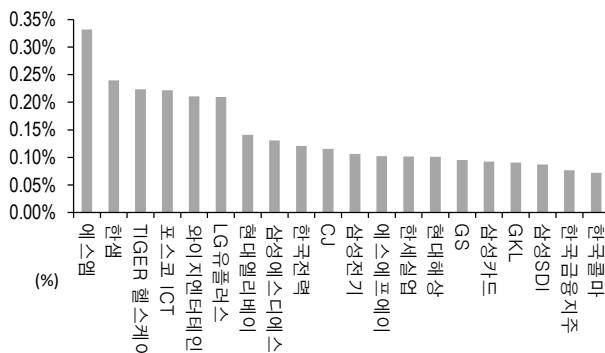
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,953,389	3,104.5	5,961,172	90,366	65,361	3,417	-70,993	73.3	7.2	-82.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성 SDI	751,000	2.74	191.6	81.6	41,408	4,344	0.09%	982	-884	-98
NAVER	441,000	5.25	467.8	72.2	93,698	9,388	0.06%	1,786	1,584	-3,436
카카오	161,000	-1.23	437.9	71.3	181,596	-677	0.06%	763	5,631	-6,466
LG 전자	164,000	3.47	113.6	64.1	56,950	13,935	0.06%	4,349	11,452	-15,967
KT	33,150	1.53	21.6	63.3	97,499	6,870	0.04%	1,967	-4,516	2,569
호텔신라	95,300	1.93	24.2	62.8	25,112	2,550	-0.01%	1,918	-815	-1,103
기아	88,300	0.46	68.2	62.0	108,805	494	0.02%	-385	2,038	-1,653
삼성전자	79,900	0.25	478.1	61.4	1,068,811	-40,400	-0.01%	31,864	-41,060	8,855
삼성전기	186,500	-0.53	39.3	60.1	39,840	-815	0.11%	-3,404	2,736	665
한나금융지주	43,700	1.27	21.9	59.7	147,815	-440	-0.01%	-252	-391	458

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터