

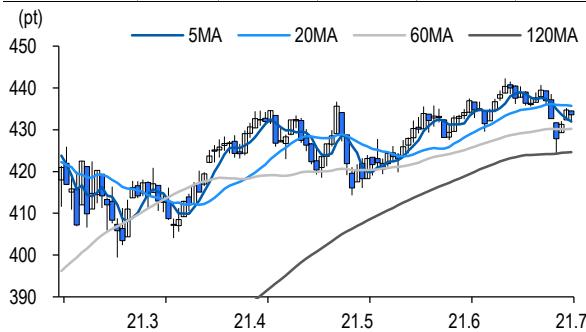


선물옵션시장 지표

2021.7.15

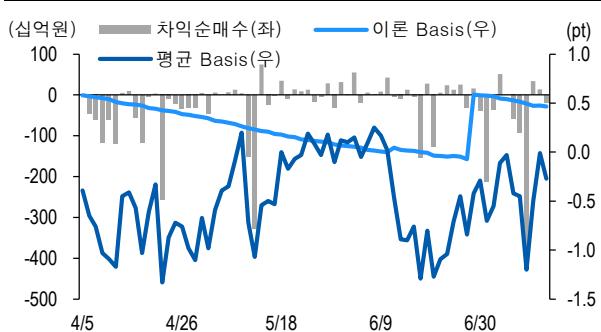
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	433.57	-0.26	-1.14	8,362.9	-
선물 9월물	433.65	-0.22	-0.95	18,147.7	240,627
선물 12월물	432.85	-0.28	-1.20	35.6	28,925
8월물(mini)	433.72	-0.19	-0.82	1,648.9	37,150
9월물(mini)	433.44	-0.27	-1.14	2.7	4,550



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.47	-0.27	0.08	-0.17%
베이시스(mini)	0.24	-0.23	0.15	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.59	-0.60	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.24	0.11	0.11	-0.03%



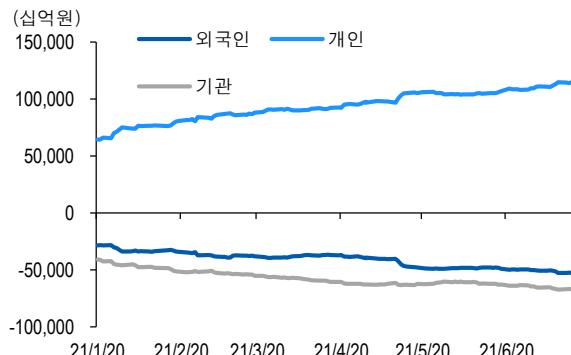
투자주체별 매매 동향

(십억원)

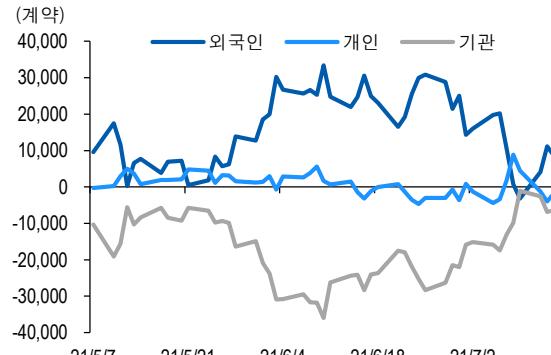
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-272.6	-9.2	-281.8	-6.5	-98.7	-253.4	-26.6	4.0	0.4	-23.1
개인	606.1	75.5	681.6	0.0	-10.0	201.9	38.1	-1.0	-1.0	67.3
기관	-316.4	-63.1	-379.5	-12.6	-40.4	75.7	-14.9	-1.3	1.1	-45.1
금융투자	-197.3	80.4	-116.9	-1.8	-13.8	251.3	-15.0	-1.1	1.2	-77.5
투신	-11.4	-14.9	-26.3	0.0	-2.6	-221.6	0.0	-0.2	0.0	23.8
은행+보험+기타금융	-0.9	-140.3	-141.3	0.0	-1.2	32.6	0.1	0.0	0.0	-1.0
연기금+국가지자체	-52.0	0.9	-51.1	-10.8	-14.7	13.4	-0.1	0.0	0.0	9.7
기타법인	-17.0	-3.3	-20.3	0.0	-2.9	-24.2	3.5	-1.7	-0.5	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	346,155	115.0	549,867	10.8%	지수옵션 전체	734,924	252.2	1,581,884
Put	388,769	137.2	1,032,017	12.3%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	12.97%(+0.42%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	442.5(K+3)	2.14	-0.26	43,027	9,490	603	10.8	437.5(K+1)
	440.0(K+2)	2.92	-0.31	32,841	12,113	488	10.9	435.0(K+0)
	437.5(K+1)	3.86	-0.38	14,504	6,142	445	11.1	432.5(K-1)
	435.0(K+0)	5.02	-0.49	8,701	8,010	420	11.3	430.0(K-2)
	432.5(K-1)	6.40	-0.50	4,426	3,585	400	11.5	427.5(K-3)

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI

