

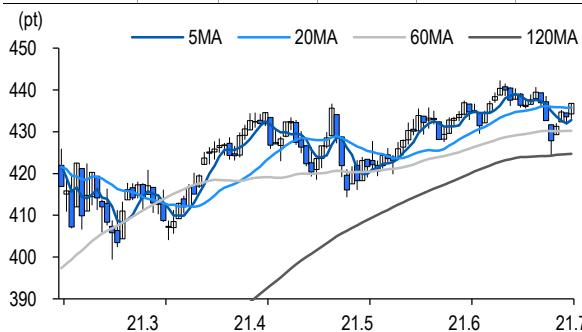


선물옵션시장 지표

2021.7.16

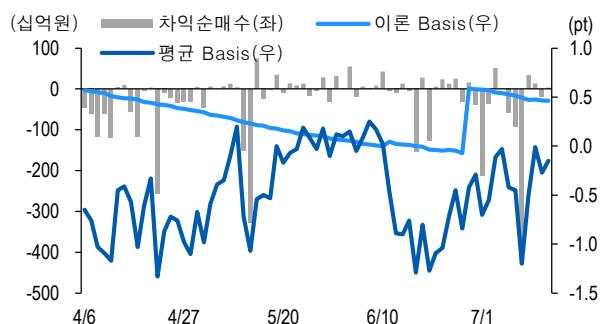
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.76	0.74	3.19	8,976.9	-
선물 9월물	436.25	0.60	2.60	17,623.8	241,768
선물 12월물	435.85	0.69	3.00	18.4	28,947
8월물(mini)	436.26	0.59	2.54	1,910.2	42,818
9월물(mini)	436.48	0.65	3.04	4.6	4,868



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.46	-0.15	-0.51	-0.14%
베이시스(mini)	0.23	-0.17	-0.50	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.57	-0.55	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.23	-0.51	-0.51	-0.17%



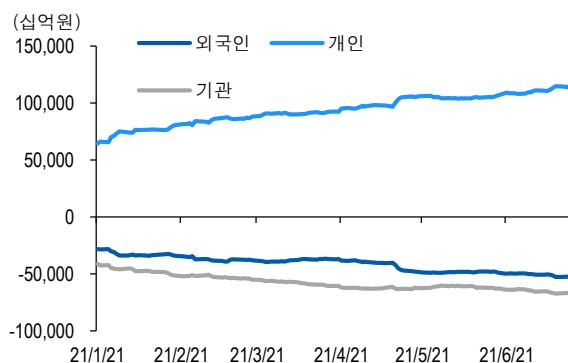
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	99.5	28.8	128.3	-7.7	17.6	402.8	35.3	0.7	0.1	17.6
개인	-337.7	11.1	-326.5	0.0	-7.1	-192.0	-75.6	0.6	0.4	18.4
기관	207.5	-44.7	162.9	11.1	-2.9	-251.6	57.6	0.3	0.2	-35.7
금융투자	225.7	32.4	258.2	0.1	-7.2	-429.8	57.7	0.6	0.4	-8.5
투신	30.9	-9.6	21.3	0.0	12.3	198.6	0.0	-0.2	-0.1	-10.9
은행+보험+기타금융	-11.1	-73.6	-84.7	0.2	2.1	2.7	0.0	0.0	-0.1	-1.0
연기금+국가지자체	-24.1	-1.0	-25.1	10.8	-4.8	-23.2	0.0	0.0	0.0	-15.3
기타법인	30.6	4.8	35.4	0.0	0.6	40.8	-17.3	-1.7	-0.6	-0.3

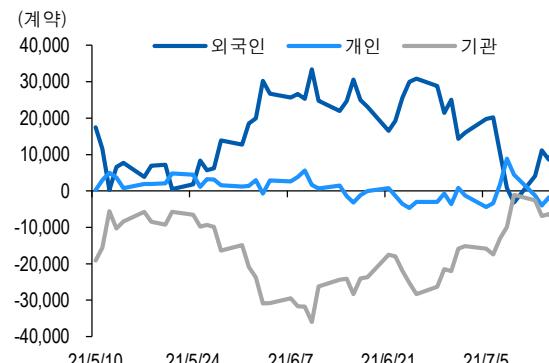
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	402,933	152.9	572,544	10.4%	지수옵션 전체	830,987	285.3	1,640,082						
Put	428,054	132.4	1,067,538	13.3%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	13.04% (+0.07%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	440.0(K+3)	3.79	0.87	30,554	12,798	685	10.5	435.0(K+1)	5.05	-1.29	4,731	5,260	1,046	12.2
	437.5(K+2)	4.90	1.04	9,429	6,861	719	10.5	432.5(K+0)	4.12	-1.08	5,659	3,373	494	12.5
Put	435.0(K+1)	6.32	1.30	8,746	8,986	976	10.7	430.0(K-1)	3.36	-0.90	11,001	8,209	2,084	12.8
	432.5(K+0)	7.87	1.47	3,967	3,619	34	10.9	427.5(K-2)	2.71	-0.74	15,792	4,948	1,659	13.1
	430.0(K-1)	9.61	1.67	2,948	4,000	667	11.1	425.0(K-3)	2.21	-0.60	24,723	10,865	395	13.5

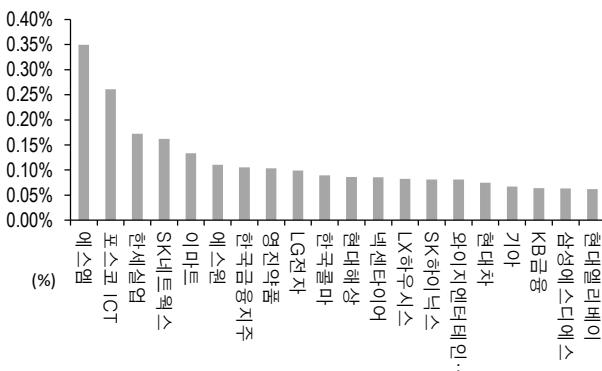
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,963,612	3,026.6	6,150,638	84,483	-16,214	33,074	-17,832	17.6	18.4	-35.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
기아	88,300	0.68	77.2	79.5	115,730	2,706	0.07%	2,973	1,313	-4,311
삼성 SDI	753,000	0.80	142.5	70.7	41,582	-530	0.00%	357	342	-697
카카오	159,500	-1.85	412.0	68.6	192,172	5,667	-0.02%	-1,914	1,824	275
호텔신라	94,300	0.64	15.7	66.1	24,750	746	-0.01%	1,251	-13	-1,238
엔씨소프트	806,000	3.87	68.0	65.9	7,126	-572	0.00%	745	1,134	-1,879
하나금융지주	43,800	1.74	20.7	65.6	147,518	-1,336	-0.03%	1,726	-4,149	2,421
삼성전자	80,600	1.26	654.5	62.9	1,085,278	2,757	-0.11%	-13,941	-18,009	31,899
NAVER	450,000	1.35	256.3	60.7	94,039	-187	0.06%	-71	-234	299
SK 하이닉스	124,000	0.81	111.1	60.4	146,385	1,103	0.08%	349	-2,458	2,104
LG 전자	161,000	0.00	59.8	57.6	62,755	1,942	0.10%	-1,233	3,090	-1,875

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터