

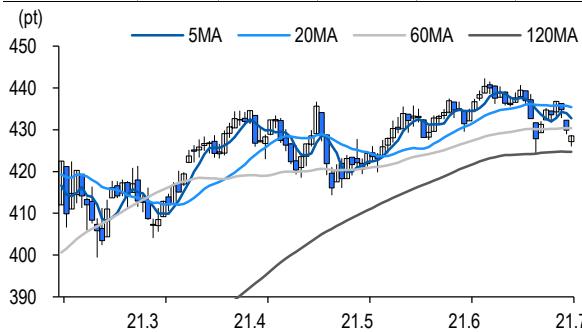


선물옵션시장 지표

2021.7.21

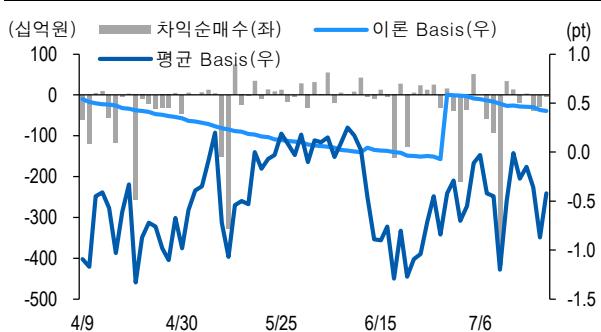
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	428.55	-0.31	-1.34	9,605.0	-
선물 9월물	428.50	-0.19	-0.80	20,224.9	243,660
선물 12월물	428.00	-0.19	-0.80	17.3	28,955
8월물(mini)	428.52	-0.21	-0.90	2,109.2	43,836
9월물(mini)	428.38	-0.21	-0.80	10.1	7,790



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.42	-0.42	-0.05	-0.20%
베이시스(mini)	0.19	-0.34	-0.03	-0.12%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.54	-0.50	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	0.02	0.02	-0.04%



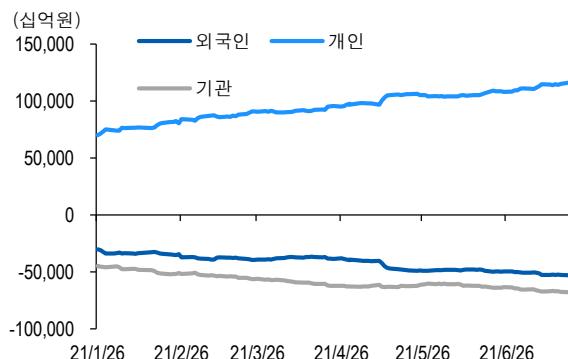
투자주체별 매매 동향

(십억원)

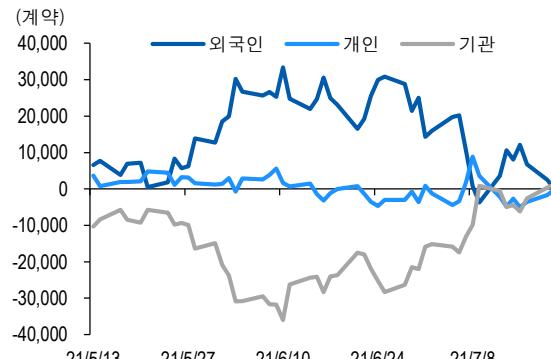
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-181.5	-8.4	-189.8	-14.0	25.7	-123.9	-119.9	1.2	1.3	2.4
개인	37.7	101.0	138.7	0.0	2.5	132.7	25.2	-0.4	1.1	67.8
기관	152.1	-98.3	53.8	10.2	24.6	4.7	90.5	1.1	-3.6	-69.9
금융투자	170.8	-204.5	-33.7	-0.3	30.6	-222.1	90.5	2.7	-3.5	-57.7
투신	1.3	16.3	17.6	2.1	-5.4	233.7	0.0	0.0	-0.1	-0.1
은행+보험+기타금융	-15.4	104.3	88.9	0.0	-4.5	14.7	0.0	-1.5	0.0	0.2
연기금+국가지자체	-15.0	2.5	-12.6	8.3	-1.3	-21.6	0.0	0.0	0.0	-12.2
기타법인	-8.3	5.6	-2.7	0.0	0.6	-13.5	4.2	-1.9	1.2	-0.3

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	497,475	163.4	625,684	12.5%	지수옵션 전체	1,087,744	395.3	1,746,963
Put	590,269	231.8	1,121,279	14.7%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	15.68% (+0.43%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	437.5(K+3)	2.21	-0.25	46,202	9,567	1,380	12.5	432.5(K+1)
	435.0(K+2)	3.00	-0.32	49,488	12,765	1,818	12.6	430.0(K+0)
	432.5(K+1)	4.02	-0.36	17,579	5,222	1,004	12.9	427.5(K-1)
	430.0(K+0)	5.21	-0.44	11,263	6,009	1,157	13.2	425.0(K-2)
	427.5(K-1)	6.61	-0.48	5,300	2,471	802	13.6	422.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	432.5(K+1)	7.95	0.42	772	4,098	-95	13.4	
	430.0(K+0)	6.64	0.38	3,605	8,732	-100	13.7	
	427.5(K-1)	5.53	0.30	5,961	7,258	149	14.0	
	425.0(K-2)	4.59	0.25	11,156	11,158	1	14.4	
	422.5(K-3)	3.78	0.20	8,026	5,687	-302	14.8	

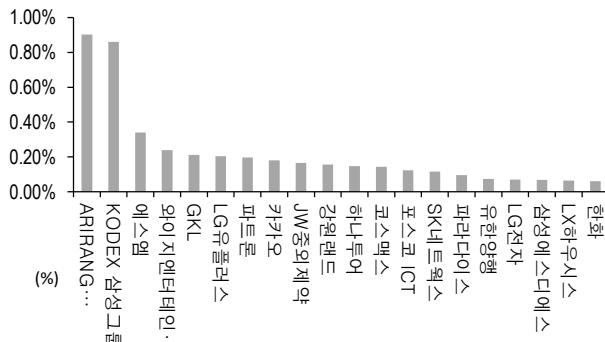
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,424,560	3,253.6	6,379,660	118,071	21,423	31,916	-52,349	2.4	67.8	-69.9
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
호텔신라	92,800	-0.75	18.0	86.3	23,489	-637	-0.02%	167	-726	559
기아	87,200	1.75	143.1	76.8	96,961	-4,976	-0.02%	4,214	-2,561	-1,653
엔씨소프트	821,000	-0.97	42.1	73.5	6,776	27	-0.14%	-88	143	-2
롯데케미칼	269,500	-1.64	42.9	70.9	12,325	124	0.04%	-1,589	825	764
NAVER	440,000	-0.90	243.0	70.6	97,544	-1,983	0.01%	869	3,008	-3,838
삼성 SDI	730,000	-2.01	129.6	70.1	43,962	118	0.05%	-1,114	1,750	-721
카카오	152,000	-2.25	623.5	62.4	208,924	7,995	0.18%	4,934	16,409	-21,373
넥센타이어	9,250	2.21	1.1	61.3	9,001	1,241	-0.17%	1,903	-1,193	-702
LG 이노텍	236,500	-1.46	25.0	60.0	14,558	390	0.00%	-175	689	-514
SK 이노베이션	259,500	0.39	68.3	58.5	31,517	-1,012	-0.13%	1,641	-176	-1,464

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터