

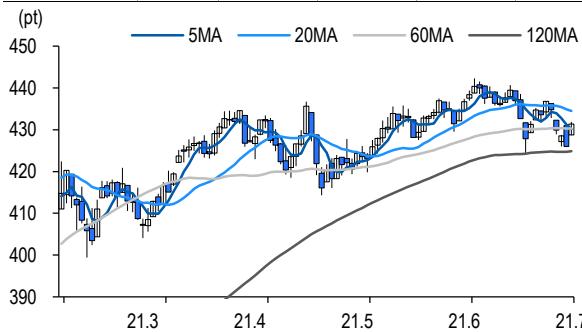


선물옵션시장 지표

2021.7.23

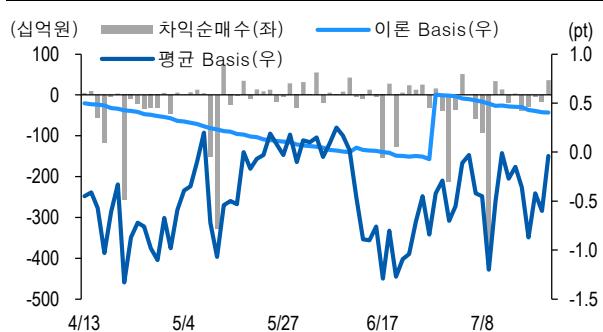
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.38	1.26	5.38	9,072.4	-
선물 9월물	431.50	1.37	5.85	18,176.4	249,151
선물 12월물	430.55	1.27	5.40	25.3	29,000
8월물(mini)	431.50	1.37	5.82	2,062.6	56,728
9월물(mini)	431.30	1.33	5.82	7.2	12,688



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.41	-0.04	0.12	-0.10%
베이시스(mini)	0.17	-0.06	0.12	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.58	-0.60	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.17	0.03	0.03	-0.03%



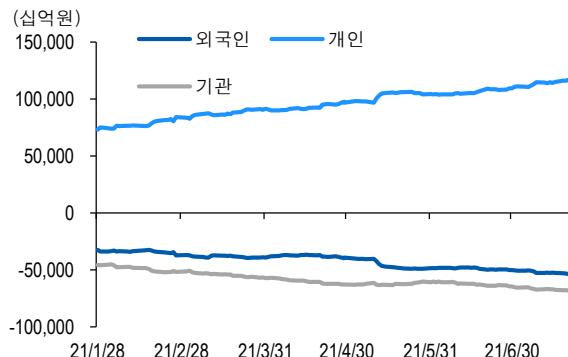
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	60.0	24.2	84.1	0.4	163.7	1,962.7	-332.7	-0.4	2.7	23.0
개인	-880.7	-73.5	-954.2	0.0	-13.0	-776.3	-119.7	-2.7	1.3	-18.5
기관	815.8	42.9	858.7	36.1	-11.1	-1,230.4	463.0	3.4	-1.5	-4.5
금융투자	827.1	18.7	845.8	6.0	-1.0	-1,601.6	462.5	3.5	-1.9	-14.1
투신	4.0	18.1	22.2	0.0	10.2	399.7	0.0	0.0	-0.1	6.4
은행+보험+기타금융	-22.6	26.0	3.4	0.0	-9.5	1.4	0.4	0.0	0.5	-1.3
연기금+국가지자체	6.1	-23.4	-17.3	30.1	-13.1	-29.8	0.2	0.0	0.0	4.4
기타법인	4.9	6.5	11.4	0.0	-0.4	43.9	-10.5	-0.4	-2.5	0.1

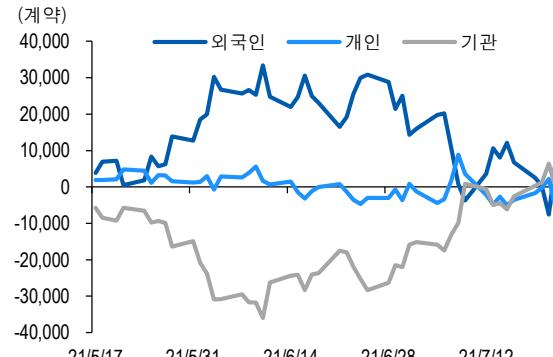
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



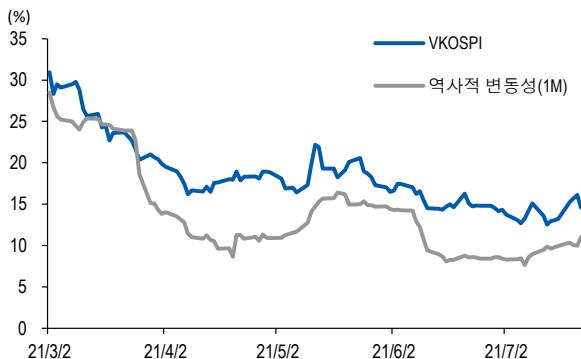
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	500,554	195.3	660,927	11.9%	지수옵션 전체	951,464	328.6	1,846,523
Put	450,910	133.3	1,185,596	14.3%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	14.60%(-1.52%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	432.5(K+3)	4.60	1.69	18,470	8,263	1,021	12.0	427.5(K+1)
	430.0(K+2)	6.03	2.16	9,774	7,045	70	12.4	425.0(K+0)
	427.5(K+1)	7.65	2.59	4,925	3,504	524	12.8	422.5(K-1)
	425.0(K+0)	9.41	2.99	4,521	4,118	1,759	13.2	420.0(K-2)
	422.5(K-1)	11.10	3.15	196	873	-51	12.9	417.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	427.5(K+1)	3.73	-3.09	8,148	8,022	737	13.1	
	425.0(K+0)	3.00	-2.68	18,794	13,615	1,461	13.6	
	422.5(K-1)	2.42	-2.29	17,517	6,742	1,013	14.0	
	420.0(K-2)	1.97	-1.92	28,989	18,722	2,783	14.6	
	417.5(K-3)	1.54	-1.70	20,845	10,728	1,127	14.9	

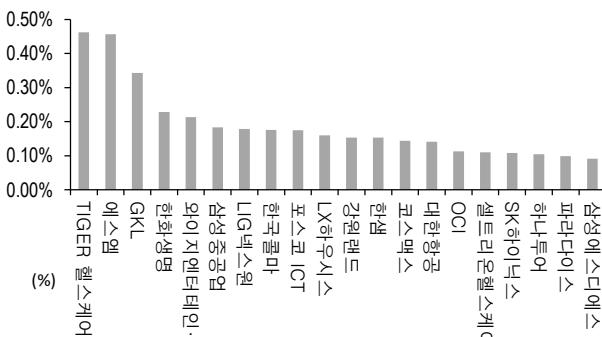
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	4,084,521	3,724.2	6,394,287	-7,804	36,135	6,798	-43,168	23.0	-18.5	-4.5	
<hr/>											
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
현대차	229,500	0.88	179.1	99.4	64,931	328	0.03%	1,516	1,571	-3,019	3,395
삼성 SDI	739,000	0.68	85.1	88.9	41,454	-959	-0.02%	-594	183	398	631
NAVER	440,500	3.16	390.5	86.2	92,907	-550	0.02%	-1,040	-1,946	2,895	2,532
기아	87,700	0.57	161.2	83.2	113,408	16,610	0.05%	1,750	5,434	-7,189	-929
호텔신라	96,000	4.58	87.9	81.1	27,815	5,815	0.03%	1,353	-3,871	2,660	-3,376
LG 이노텍	233,500	-0.43	18.1	78.8	13,945	-663	-0.09%	166	473	-652	284
하나금융지주	44,150	4.62	54.6	76.3	165,591	19,668	0.05%	-3,714	-11,545	15,715	-4,014
삼성전자	79,600	1.40	761.5	76.1	1,065,811	-10,289	-0.03%	14,126	-5,523	-8,362	-15,811
카카오	148,500	3.13	529.1	63.3	176,982	-933	0.05%	5,812	-4,998	-861	-1,905
엔씨소프트	794,000	-1.61	51.9	61.4	7,313	333	-0.09%	333	88	-386	114
<hr/>											

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터