

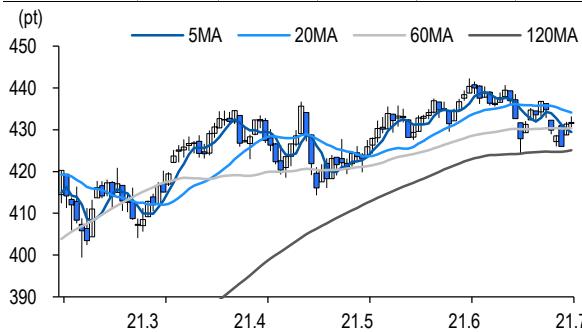


선물옵션시장 지표

2021.7.26

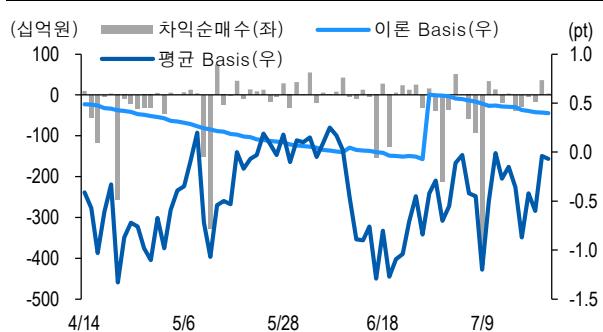
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.55	0.04	0.17	8,440.8	-
선물 9월물	431.50	0.00	0.00	15,160.6	247,174
선물 12월물	430.90	0.08	0.35	25.0	29,017
8월물(mini)	431.52	0.00	0.02	1,379.5	57,467
9월물(mini)	431.76	0.06	0.46	3.5	12,753



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.40	-0.07	-0.05	-0.11%
베이시스(mini)	0.17	-0.09	-0.03	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.58	-0.55	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.17	0.01	0.01	-0.04%



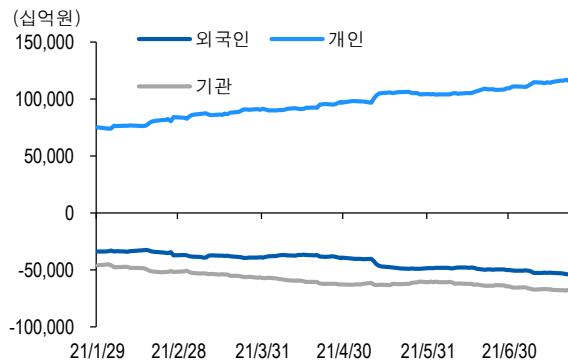
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-164.9	-11.3	-176.2	0.0	-17.5	48.6	-36.4	-1.1	0.7	-5.6
개인	-88.9	-7.1	-96.0	0.0	-3.2	183.3	16.7	1.1	-0.9	42.8
기관	263.5	18.8	282.3	3.3	-0.1	-284.1	22.0	0.1	0.1	-38.7
금융투자	369.9	-17.4	352.5	3.3	-5.4	-124.1	22.5	0.2	0.2	-19.2
투신	-36.3	-5.7	-42.0	0.0	-4.9	-147.4	0.0	0.0	-0.1	1.4
은행+보험+기타금융	-8.2	44.5	36.3	0.0	-0.6	-13.0	-0.5	0.0	0.0	-0.6
연기금+국가지자체	-67.2	-3.7	-70.9	0.0	8.2	0.3	0.0	0.0	0.0	-20.2
기타법인	-9.7	-0.4	-10.2	0.0	-0.7	52.2	-2.3	-0.2	0.0	1.5

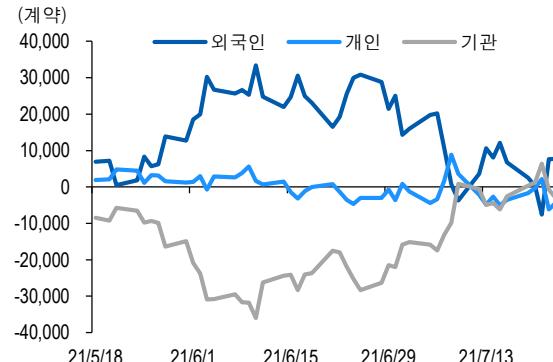
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



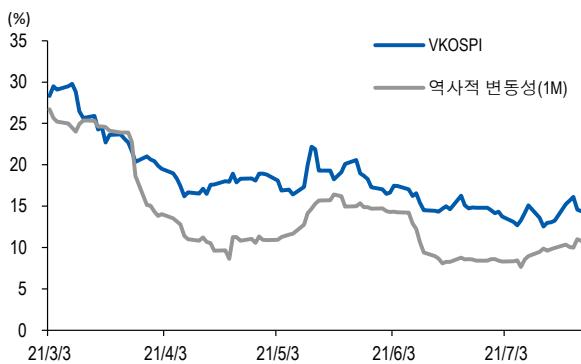
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	377,267	134.8	677,452	11.2%	지수옵션 전체		845,710	276.2	1,889,395
Put	468,443	141.3	1,211,943	13.2%	PCR(금액기준)		1.05	VKOSPI	14.42%(-0.18%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	440.0(K+3)	1.63	-0.10	55,485	23,425	650	11.1	435.0(K+1)	6.76
	437.5(K+2)	2.34	-0.13	51,492	12,615	-216	11.2	432.5(K+0)	5.39
	435.0(K+1)	3.29	-0.13	26,247	17,161	693	11.5	430.0(K-1)	4.31
	432.5(K+0)	4.45	-0.15	9,791	8,757	494	11.7	427.5(K-2)	3.45
	430.0(K-1)	5.86	-0.17	5,280	7,670	625	12.0	425.0(K-3)	2.74
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	435.0(K+1)	6.76	-0.27	1,589	5,017	-66	11.9	432.5(K+0)	5.39
	432.5(K+0)	5.39	-0.31	4,173	4,968	375	12.1	430.0(K-1)	4.31
	430.0(K-1)	4.31	-0.29	8,914	10,447	882	12.4	427.5(K-2)	3.45
	427.5(K-2)	3.45	-0.28	13,569	8,541	519	12.9	425.0(K-3)	2.74
	425.0(K-3)	2.74	-0.26	26,279	14,998	1,383	13.3		

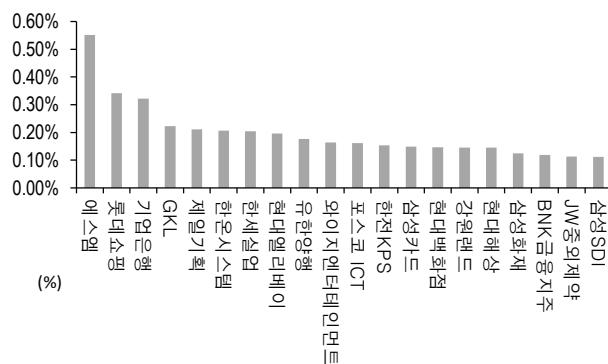
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,352,067	3,413.6	6,418,818	24,531	8,558	35,787	-44,386	-5.6	42.8	-38.7		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수		
엔씨소프트	812,000	2.27	45.0	94.6	7,244	-69	-0.06%	192	-493	300	125	331
호텔신라	94,600	-1.46	25.2	94.2	24,403	-3,412	-0.02%	-1,969	1,667	212	341	2,768
NAVER	453,000	2.84	417.0	87.2	98,949	6,042	0.07%	2,033	472	-2,479	-5,209	-2,771
LG화학	827,000	0.24	87.7	85.3	16,042	218	-0.12%	371	25	-394	-174	-221
삼성전자	79,400	-0.25	557.4	78.0	1,054,911	-10,900	-0.02%	-18,591	1,986	15,597	28,823	-13,047
삼성SDI	752,000	1.76	131.5	69.7	44,268	2,814	0.11%	1,077	901	-1,980	-1,884	-1,518
삼성전기	183,000	-1.61	30.6	65.8	31,217	-4,220	-0.04%	-1,221	-2,661	3,881	2,381	1,774
하나금융지주	44,250	0.23	44.3	65.7	151,668	-13,923	-0.05%	-2,279	-2,191	4,630	6,143	7,840
기아	86,500	-1.37	143.7	63.9	101,964	-11,444	0.00%	-3,891	1,250	2,628	902	8,383
SK하이닉스	118,000	-1.26	130.9	63.8	157,687	-9,455	-0.05%	2,070	13,098	-15,170	-3,183	-1,500

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터