

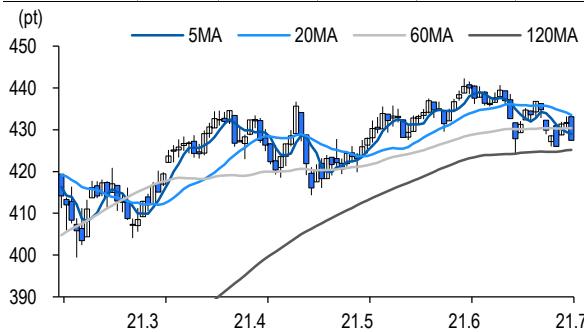


선물옵션시장 지표

2021.7.27

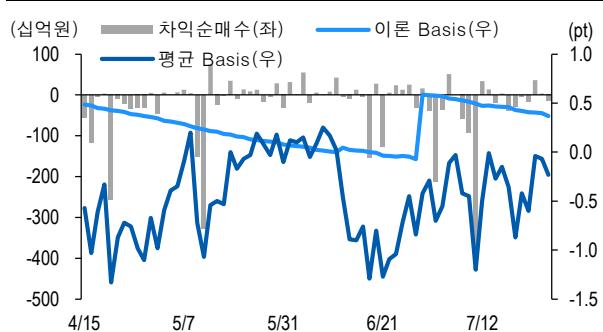
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	427.47	-0.95	-4.08	7,715.6	-
선물 9월물	428.00	-0.81	-3.50	19,711.2	251,997
선물 12월물	427.45	-0.80	-3.45	25.7	29,040
8월물(mini)	427.92	-0.83	-3.60	1,908.6	58,737
9월물(mini)	427.70	-0.88	-4.06	4.4	12,770



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.37	-0.23	0.53	-0.14%
베이시스(mini)	0.14	-0.18	0.45	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.55	-0.50	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.14	0.52	0.52	0.09%



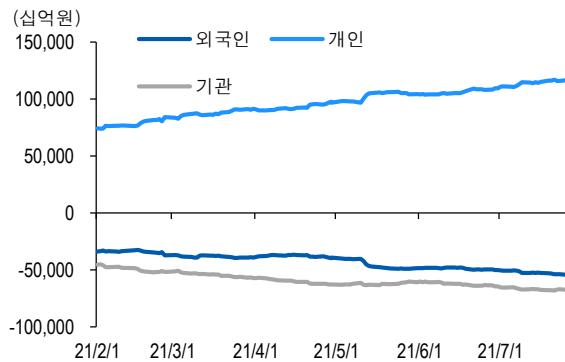
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-375.6	-11.1	-386.7	0.0	-316.8	-924.9	20.9	3.6	3.2	2.0
개인	723.5	94.3	817.8	0.0	11.5	562.7	93.7	1.7	-1.0	40.3
기관	-337.2	-90.9	-428.2	-14.4	-95.1	403.4	-130.7	-1.5	-2.0	-46.0
금융투자	-70.0	-53.6	-123.6	-1.4	-10.0	630.3	-130.5	-1.0	-1.8	0.6
투신	-111.2	-1.6	-112.8	0.0	-64.3	-340.2	-0.2	0.0	-0.1	-58.6
은행+보험+기타금융	3.0	-39.3	-36.3	0.0	3.7	103.3	0.0	-0.5	-0.1	-1.7
연기금+국가지자체	-69.1	-1.7	-70.8	-13.0	-3.8	10.0	0.0	0.0	0.0	13.6
기타법인	-10.6	7.7	-2.9	0.0	0.2	-41.3	16.1	-3.8	-0.2	3.7

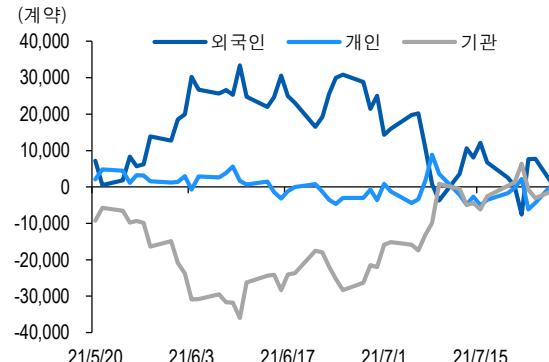
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	468,983	145.5	690,800	13.1%	지수옵션 전체	1,059,551	371.6	1,906,104							
Put	590,568	226.1	1,215,304	13.9%	PCR(금액기준)	1.55	VKOSPI	16.05%(+1.63%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	440.0(K+3)	1.05	-0.58	73,749	24,746	1,321	12.9	Put	435.0(K+1)	9.33	2.57	2,076	4,940	-77	12.5
	437.5(K+2)	1.53	-0.81	52,359	14,301	1,686	13.0		432.5(K+0)	7.60	2.21	3,538	4,790	-178	12.5
	435.0(K+1)	2.22	-1.07	38,280	16,484	-677	13.3		430.0(K-1)	6.20	1.89	11,347	10,805	358	12.9
	432.5(K+0)	3.09	-1.36	19,623	9,438	681	13.6		427.5(K-2)	5.05	1.60	17,141	8,830	289	13.5
	430.0(K-1)	4.20	-1.66	11,545	8,289	619	14.0		425.0(K-3)	4.10	1.36	34,040	15,671	673	14.1

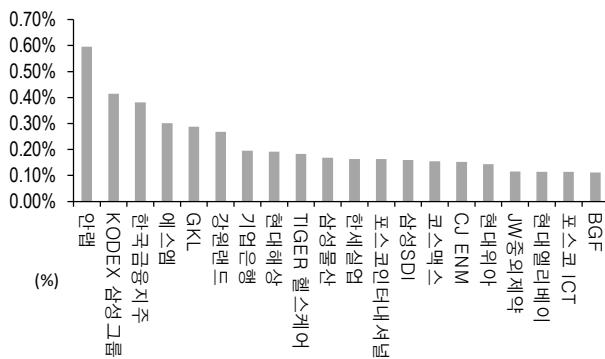
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,988,839	3,054.9	6,430,810	11,992	3,898	31,119	-36,452	2.0	40.3	-46.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
하나금융지주	44,000	-0.56	39.5	102.3	139,757	-11,911	-0.02%	2,874	5,563	-8,452
삼성SDI	739,000	-1.73	164.3	97.5	46,772	2,504	0.16%	-600	3,596	-3,476
호텔신라	93,200	-1.48	20.8	90.2	22,929	-1,474	-0.09%	508	739	-1,257
NAVER	453,000	0.00	335.9	86.6	94,155	-4,794	0.00%	-2,546	172	2,275
LG전자	163,000	-2.40	104.2	74.7	63,312	2,233	0.04%	-746	1,369	-758
KT	33,650	-3.30	36.6	74.1	83,702	-2,413	-0.05%	1,625	-424	-1,194
SK텔레콤	307,500	0.99	37.3	73.9	15,465	-613	-0.04%	10,826	6,354	-17,221
삼성전기	181,500	-0.82	31.8	73.1	30,218	-999	-0.08%	-2,425	-2,743	5,168
롯데케미칼	272,000	0.93	29.0	72.3	12,138	495	0.06%	135	223	-368
SK하이닉스	117,000	-0.85	153.0	71.1	161,293	3,606	-0.06%	1,815	-1,324	-592

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터