

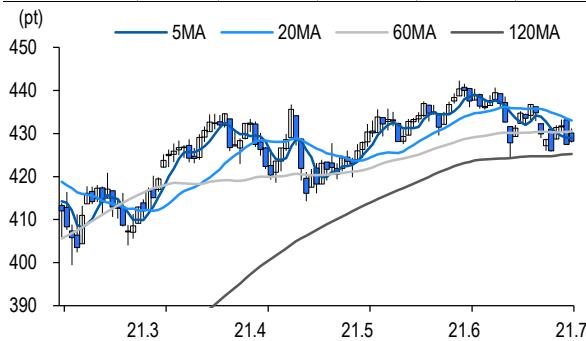


## 선물옵션시장 지표

2021.7.28

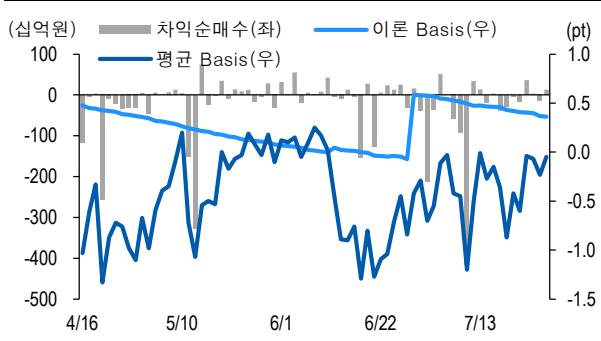
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	428.22	0.18	0.75	7,837.3	-
선물 9월물	428.15	0.04	0.15	21,036.3	249,414
선물 12월물	427.65	0.05	0.20	29.5	29,061
8월물(mini)	428.18	0.06	0.26	1,931.0	61,146
9월물(mini)	427.98	0.00	0.28	4.9	13,284



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.36	-0.05	-0.07	-0.10%
베이시스(mini)	0.13	-0.09	-0.04	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.53	-0.60	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-0.07	-0.07	-0.05%



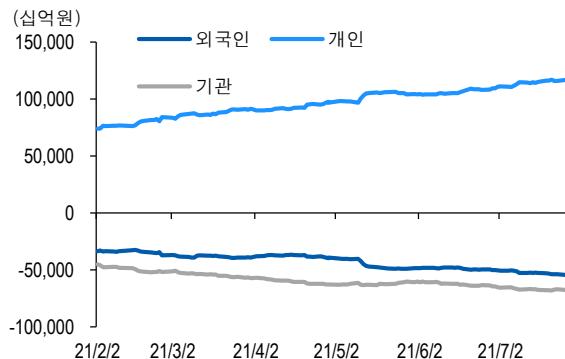
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	44.7	-17.7	27.0	0.0	212.2	850.8	-129.3	2.1	1.4	-14.5
개인	-280.9	33.6	-247.3	0.0	16.2	-326.1	-17.6	-3.3	0.2	16.5
기관	226.8	-18.0	208.9	12.7	-17.0	-498.3	146.0	1.5	-1.5	-2.7
금융투자	236.6	-34.1	202.5	2.5	-22.4	-595.0	145.9	1.6	-1.5	-20.4
투신	7.2	-13.5	-6.3	0.0	-8.0	189.3	0.0	0.0	0.0	13.3
은행+보험+기타금융	-7.7	11.2	3.4	-0.5	-6.1	-81.8	0.1	-0.1	0.1	-0.1
연기금+국가지자체	25.4	0.4	25.8	10.8	20.2	-10.8	0.0	0.0	0.0	4.5
기타법인	9.4	2.1	11.4	0.0	0.3	-26.5	0.9	-0.2	-0.1	0.7

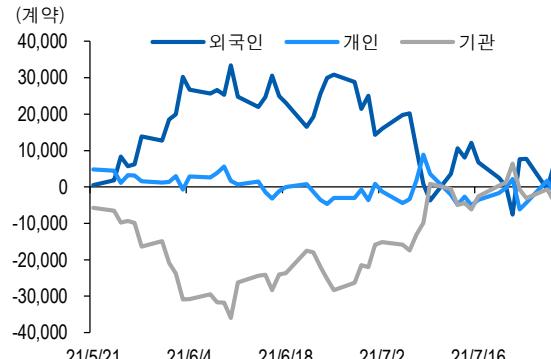
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이





## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	488,221	171.4	697,243	12.4%	지수옵션 전체		1,137,094	370.4	1,930,557						
Put	648,873	199.0	1,233,314	14.8%	PCR(금액기준)		1.16	VKOSPI	15.75%(-0.30%)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량			
Call	435.0(K+3)	2.04	-0.18	57,818	17,574	1,090	12.4	Put	430.0(K+1)	5.85	-0.35	8,669	11,580	775	13.5
	432.5(K+2)	2.88	-0.21	28,928	9,575	137	12.6		427.5(K+0)	4.68	-0.37	15,337	9,622	792	13.8
	430.0(K+1)	3.98	-0.22	14,446	8,857	568	12.9		425.0(K-1)	3.73	-0.37	30,522	15,805	134	14.3
	427.5(K+0)	5.33	-0.21	5,633	4,009	-60	13.3		422.5(K-2)	2.95	-0.36	32,796	7,972	186	14.7
	425.0(K-1)	6.86	-0.20	2,386	4,275	-110	13.6		420.0(K-3)	2.35	-0.30	56,691	19,362	617	15.2

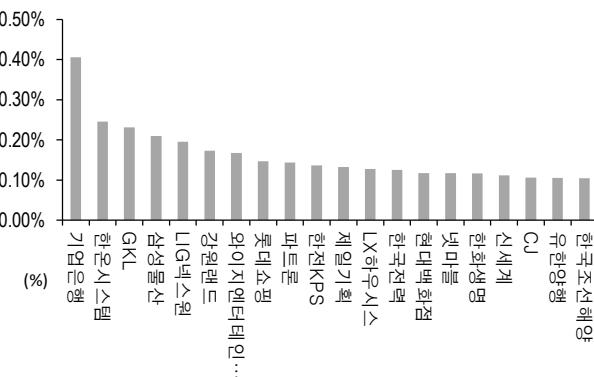
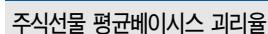
---

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 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	3,450,398	3,335.2	6,470,771	39,961	-29,167	53,313	-23,674	-14.5	16.5	-2.7		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,100	0.23	37.8	126.1	146,028	6,271	0.02%	-6,083	-554	6,656	-1,699	-1,704
엔씨소프트	807,000	-2.06	55.7	86.0	6,748	-163	-0.06%	-298	153	172	363	-101
NAVER	453,000	0.00	287.6	83.6	89,877	-4,278	-0.02%	-610	-1,115	1,722	1,959	1,395
호텔신라	93,700	0.54	18.4	82.1	22,329	-600	-0.01%	283	-543	234	80	154
KT	33,200	-1.34	26.7	80.0	81,987	-1,715	-0.06%	4,671	2,899	-7,585	-2,687	1,606
SK 텔레콤	303,000	-1.46	33.8	79.3	15,170	-295	-0.12%	-1,910	225	1,667	473	1,224
삼성 SDI	761,000	2.98	249.6	76.3	47,896	1,124	0.07%	-315	-558	843	-880	592
기아	86,300	0.35	71.7	69.8	102,065	2,614	0.02%	6,724	-2,627	-4,089	836	-5,111
LG 유플러스	14,600	-0.34	7.9	69.1	118,942	4,838	-0.20%	-11,026	1,704	9,226	9,226	0
LG 전자	162,500	-0.31	48.0	69.0	55,245	-8,067	-0.13%	2,125	-608	-1,681	-1,424	1,410

---

자료: KBX 유티즌워리 리서치센터