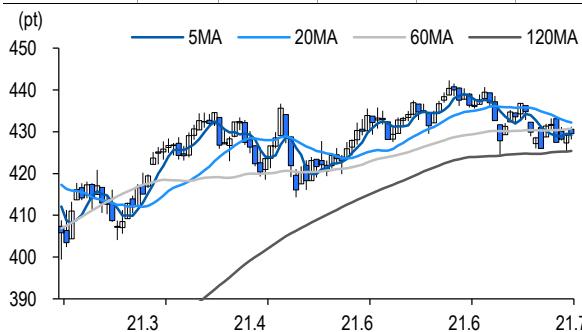


선물옵션시장 지표

2021.7.30

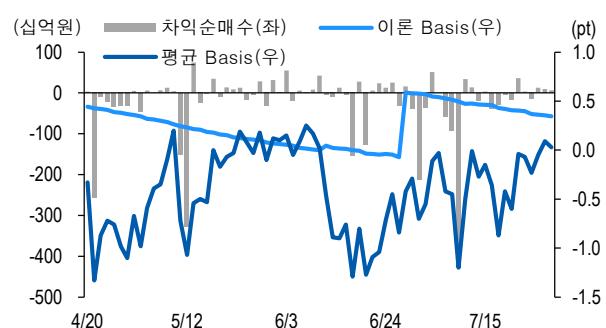
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.49	0.08	0.34	7,074.7	-
선물 9월물	429.40	0.17	0.75	23,996.8	250,221
선물 12월물	428.95	0.16	0.70	26.1	29,071
8월물(mini)	429.38	0.17	0.74	1,902.4	66,940
9월물(mini)	429.66	0.23	0.66	3.8	14,521



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.35	0.03	-0.09	-0.07%
베이시스(mini)	0.12	-0.06	-0.11	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.59	-0.60	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	-0.18	-0.18	-0.07%



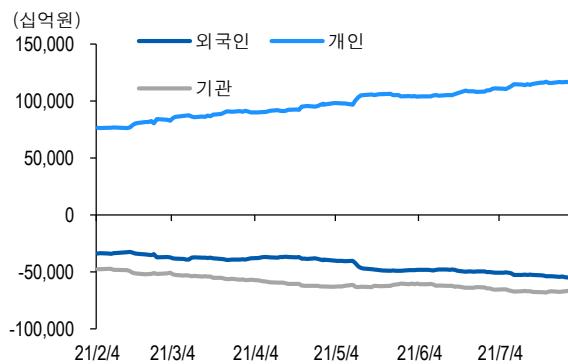
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-226.5	11.2	-215.3	0.0	-304.3	138.2	4.0	-0.6	0.5	-14.6
개인	-16.8	-5.3	-22.1	0.0	1.8	9.5	2.0	0.5	1.0	-34.5
기관	258.1	-5.5	252.7	6.4	51.6	-162.3	-8.0	0.2	-1.5	47.9
금융투자	235.7	-55.6	180.1	4.1	8.9	-232.6	-12.2	0.2	-0.8	44.3
투신	49.3	4.1	53.4	0.0	36.2	94.3	-0.3	0.0	-0.1	3.3
은행+보험+기타금융	-26.3	54.5	28.2	0.0	2.3	-30.1	4.3	0.0	-0.7	1.4
연기금+국가지자체	-44.2	-5.4	-49.6	2.3	-7.0	6.1	0.2	0.0	0.0	-1.1
기타법인	-14.8	-0.4	-15.2	0.0	-0.5	14.5	2.0	-0.1	0.0	1.1

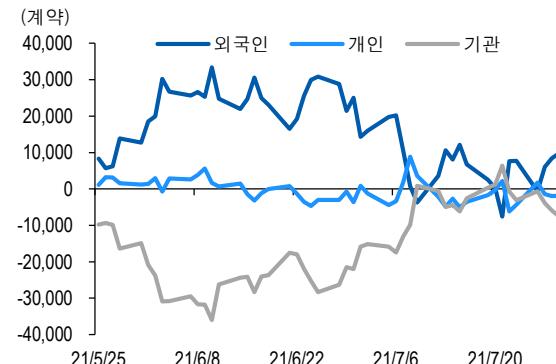
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



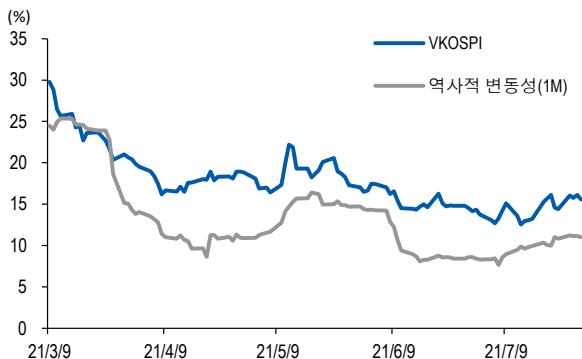
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	592,481	193.9	718,546	11.7%	지수옵션 전체	1,394,445	435.6	1,997,834							
Put	801,964	241.7	1,279,288	14.3%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI	15.58%(-0.53%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	437.5(K+3)	1.29	-0.16	89,700	17,103	239	11.6	Put	432.5(K+1)	6.03	-0.75	5,243	4,871	45	12.7
	435.0(K+2)	1.95	-0.18	77,875	17,487	-1,109	11.7		430.0(K+0)	4.75	-0.79	16,971	12,929	1,357	13.1
	432.5(K+1)	2.87	-0.18	44,733	11,996	994	11.9		427.5(K-1)	3.68	-0.73	21,170	11,142	1,097	13.5
	430.0(K+0)	4.06	-0.10	23,201	11,992	1,539	12.2		425.0(K-2)	2.86	-0.66	36,070	17,283	595	13.9
	427.5(K-1)	5.50	-0.05	8,216	5,603	512	12.6		422.5(K-3)	2.21	-0.58	35,610	8,464	341	14.5

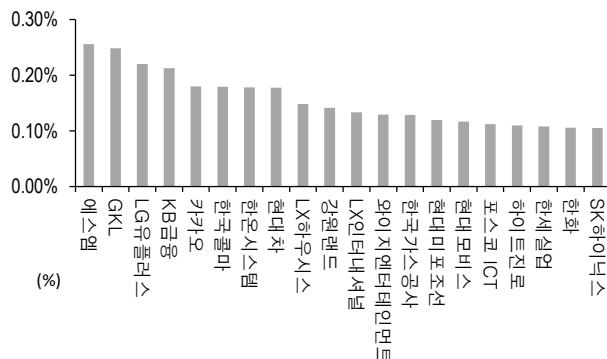
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,313,165	3,069.8	6,480,114	-3,473	-45,271	-16,110	61,325	-14.6	-34.5	47.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
호텔신라	94,500	0.85	22.4	98.3	21,941	-368	-0.01%	672	-26	-646
하나금융지주	44,700	-0.33	44.1	97.5	154,489	-239	0.07%	-7,512	3,820	3,644
NAVER	439,500	-0.68	230.6	94.1	82,850	-5,463	-0.05%	1,676	-910	-760
삼성SDI	763,000	0.53	139.3	92.1	42,025	-2,331	-0.18%	-706	-253	966
기아	86,600	0.70	77.3	84.9	94,107	-223	0.05%	1,686	-1,212	-474
삼성전자	79,000	0.00	852.8	77.8	990,063	-29,052	-0.05%	-9,479	4,298	5,379
KT	33,750	-0.15	20.0	77.2	76,774	-2,862	0.01%	114	432	-546
현대제철	53,400	-1.11	28.8	69.3	32,089	-11,845	-0.10%	-1,720	974	734
SK텔레콤	312,000	0.65	30.5	66.9	16,095	-949	-0.10%	-1,785	-179	1,959
LG화학	834,000	0.12	74.7	64.5	16,028	70	-0.12%	-462	127	314

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터