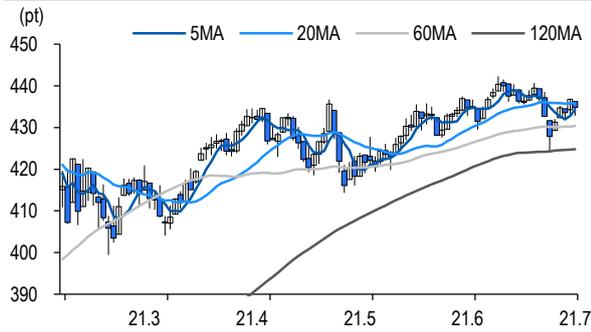


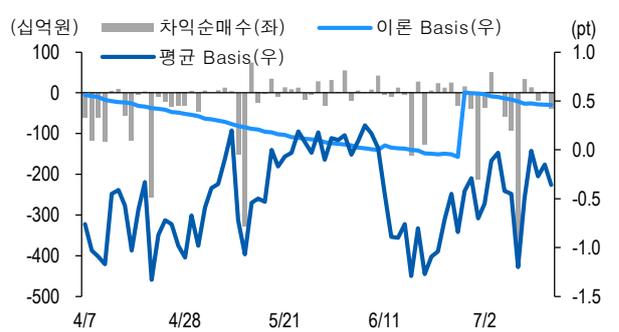
선물옵션시장 지표

2021.7.19

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.82	-0.44	-1.94	8,616.8	-
선물 9월물	434.10	-0.49	-2.15	18,526.5	237,389
선물 12월물	433.65	-0.50	-2.20	19.0	28,937
8월물(mini)	434.32	-0.44	-1.94	2,050.1	34,679
9월물(mini)	434.08	-0.50	-2.40	3.0	4,927



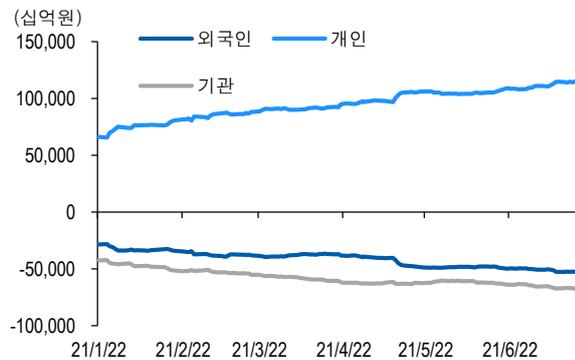
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.46	-0.36	-0.72	-0.19%
베이스스(mini)	0.23	-0.27	-0.50	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.55	-0.50	-0.16%
합성선물 베이스스(ATM)	0.23	-0.63	-0.63	-0.20%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-90.8	-3.8	-94.7	0.0	54.5	-728.5	148.9	2.9	1.9	51.4
개인	694.9	31.6	726.5	0.0	-0.1	83.3	81.1	2.8	-1.6	-9.3
기관	-571.8	-25.3	-597.1	-39.0	39.5	633.8	-248.6	-2.2	-1.1	-42.7
금융투자	-353.1	-15.8	-368.9	-10.8	37.9	876.1	-248.1	-2.4	-1.1	-25.8
투신	-80.3	-1.6	-81.9	0.0	-4.5	-254.0	0.1	0.0	-0.1	-20.2
은행+보험+기타금융	-28.4	-7.9	-36.3	0.0	-3.9	0.0	-0.5	0.1	0.0	-0.1
연기금+국가자재	-24.3	-1.4	-25.6	-28.2	5.9	11.7	-0.1	0.0	0.0	3.5
기타법인	-32.3	-2.4	-34.8	0.0	0.7	11.5	18.6	-3.4	0.8	0.7

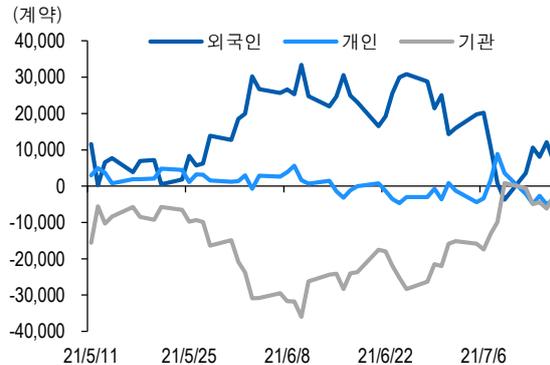
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



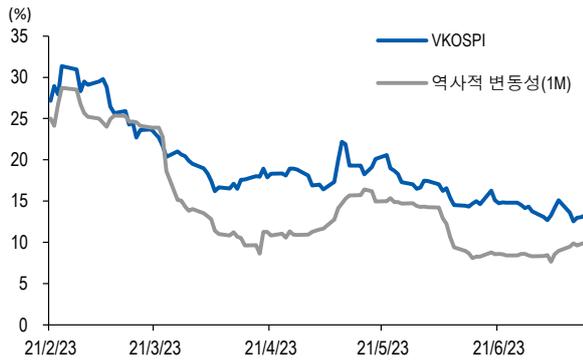
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	333,072	123.2	574,430	10.4%	지수옵션 전체	760,538	284.8	1,659,982		
Put	427,466	161.5	1,085,552	12.7%	PCR(금액기준)	1.31	VKOSPI	13.23%(+0.19%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	445.0(K+3)	1.52	-0.52	47,060	18,841	1,906	10.3	Put	440.0(K+1)	8.70	1.17	593	1,727	52	12.2
	442.5(K+2)	2.16	-0.66	41,322	9,785	5	10.4		437.5(K+0)	7.26	1.09	1,713	1,866	93	12.4
	440.0(K+1)	2.96	-0.83	29,090	13,158	360	10.5		435.0(K-1)	5.91	0.86	5,104	5,335	75	12.4
	437.5(K+0)	3.95	-0.95	12,576	7,239	378	10.5		432.5(K-2)	4.80	0.68	5,403	3,793	420	12.5
	435.0(K-1)	5.16	-1.16	8,399	9,260	274	10.7		430.0(K-3)	3.89	0.53	9,829	8,493	284	12.7

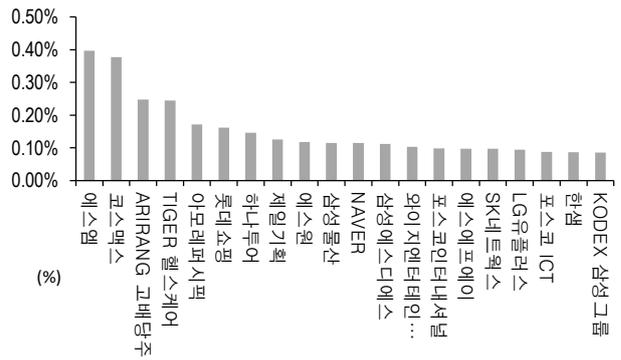
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



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	2,882,240	3,160.2	6,179,557	28,919	41,324	-35,964	-1,337	51.4	-9.3	-42.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	447,500	-0.56	572.8	102.0	102,876	8,837	0.11%	2,003	5,299	-7,274	-6,463	-1,214
하나투어	79,700	0.89	9.2	93.5	6,846	2,276	0.15%	-63	-63	127	-4,536	-87
삼성 SDI	750,000	-0.40	98.5	86.6	42,785	1,203	0.07%	-323	937	-613	-781	-94
호텔신라	95,100	0.85	15.9	84.3	25,563	813	0.01%	447	-52	-395	-612	217
아모레퍼시픽	245,500	0.00	16.2	74.4	14,098	-380	0.17%	56	1,620	-1,676	-1,969	-832
GS 건설	43,850	-0.34	13.1	74.2	47,876	-119	0.00%	550	-289	-261	-1,601	1,335
삼성전자	80,000	-0.74	619.1	71.9	1,040,170	-45,108	-0.02%	42,443	-36,403	-6,041	12,291	-12,400
롯데케미칼	270,000	0.37	21.1	68.3	9,665	-42	-0.04%	198	302	-500	-163	-337
코스맥스	139,000	0.00	6.9	64.0	3,499	1,522	0.38%	796	-200	-505	-1,578	-206
SK 하이닉스	121,500	-2.02	221.5	63.0	151,651	5,266	-0.16%	-2,510	3,515	-1,001	9,702	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터