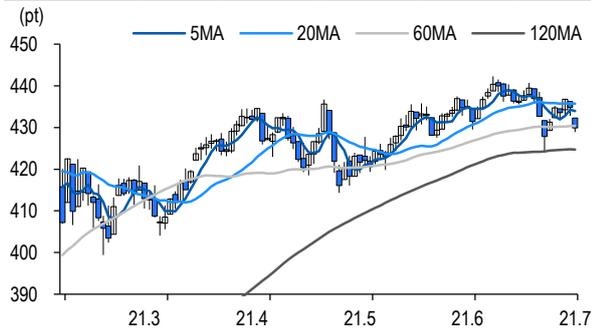


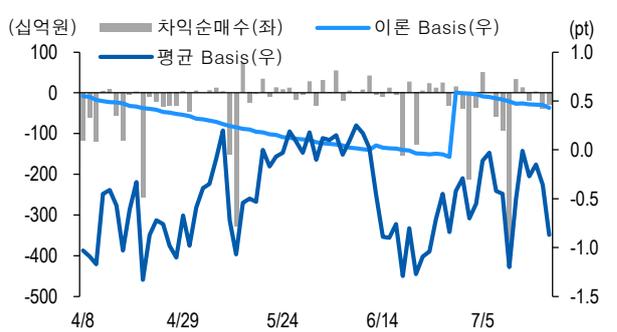
선물옵션시장 지표

2021.7.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.89	-1.13	-4.93	7,243.1	-
3월물(big)	429.30	-1.11	-4.80	18,970.2	240,849
6월물(big)	428.80	-1.12	-4.85	18.5	28,939
8월물(mini)	429.42	-1.13	-4.90	2,191.2	43,436
9월물(mini)	429.18	-1.13	-4.90	5.8	7,800

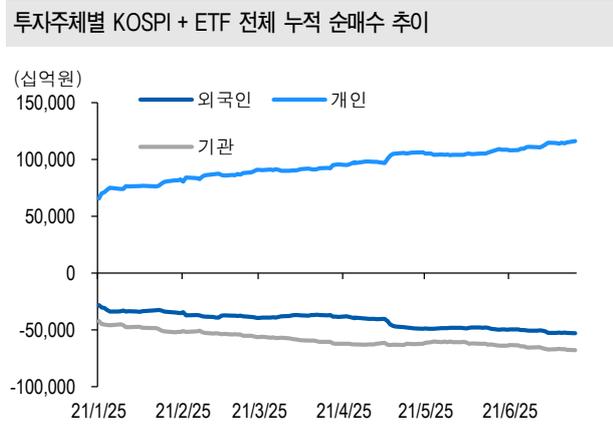


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.43	-0.87	-0.59	-0.30%
베이스스(mini)	0.20	-0.73	-0.47	-0.22%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.49	-0.50	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.20	-0.56	-0.56	-0.18%

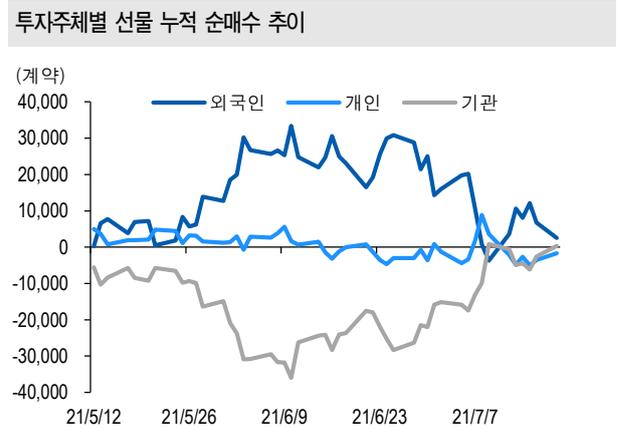


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-454.3	-12.4	-466.7	-5.6	-369.8	-454.7	4.3	3.3	4.7	10.8
개인	936.1	65.6	1,001.6	0.0	-4.2	153.8	42.5	-2.4	0.7	42.1
기관	-455.9	-49.5	-505.4	-21.8	-2.2	365.2	-50.7	1.0	-5.3	-51.7
금융투자	-244.3	-99.3	-343.6	-17.4	-1.4	468.0	-51.3	1.3	-4.8	-51.1
투신	-63.2	4.4	-58.7	0.0	-16.4	-99.7	0.1	-0.3	-0.1	-29.0
은행+보험+기타금융	-10.7	23.6	12.9	0.0	5.3	0.6	0.5	0.0	-0.4	-0.4
연기금+국가자재	-97.0	20.3	-76.7	-4.4	3.1	-3.7	0.0	0.0	0.0	28.9
기타법인	-25.9	-3.7	-29.6	0.0	-0.2	-64.4	4.0	-2.0	-0.1	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	335,092	114.9	597,759	11.8%	지수옵션 전체	856,367	322.9	1,703,229
Put	521,275	208.0	1,105,470	14.3%	PCR(금액기준)	1.81	VKOSPI	15.25%(+2.02%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	1.26	-0.90	36,509	11,491	1,706	11.7	Put	437.5(K+1)	10.70	3.44	282	1,831	-35	14.0
	440.0(K+2)	1.81	-1.15	45,172	14,039	881	11.8		435.0(K+0)	8.99	3.08	2,192	5,362	27	13.8
	437.5(K+1)	2.46	-1.49	26,422	8,187	948	11.9		432.5(K-1)	7.53	2.73	3,039	4,193	400	13.9
	435.0(K+0)	3.32	-1.84	18,812	10,947	1,687	12.0		430.0(K-2)	6.26	2.37	5,646	8,832	339	14.1
	432.5(K-1)	4.38	-2.20	5,383	4,218	557	12.2		427.5(K-3)	5.23	2.09	8,926	7,109	842	14.4

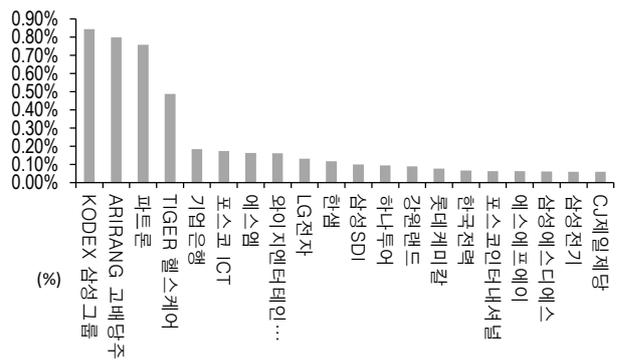
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	2,570,064	2,401.6	6,261,589	82,032	11,380	66,826	-72,987	10.8	42.1	-51.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	745,000	-0.67	107.2	91.9	43,844	1,059	0.10%	351	661	-998	-969	-326
NAVER	444,000	-0.78	241.8	78.2	99,527	-3,349	0.02%	-1,575	-2,294	3,819	727	3,260
LG 이노텍	240,000	-0.62	31.4	77.4	14,168	-995	-0.05%	1,012	-15	-997	-813	155
엔씨소프트	829,000	-0.84	47.8	76.5	6,749	-445	-0.11%	-783	634	149	-215	602
호텔신라	93,500	-1.68	19.1	74.8	24,126	-1,437	0.00%	-780	422	363	-798	1,338
하나금융지주	42,800	-2.39	23.9	69.8	148,545	1,319	-0.05%	663	3,551	-4,234	-173	805
롯데케미칼	274,000	1.48	49.8	68.8	12,201	2,536	0.08%	1,434	853	-2,732	-516	-2,780
GS 건설	43,600	-0.57	12.1	58.7	48,842	966	0.02%	1,222	865	-2,087	-2,835	743
현대건설	57,300	-1.88	16.6	57.2	26,935	-3,615	-0.05%	-311	-298	609	648	4,602
LG 화학	820,000	-0.61	51.3	55.7	16,138	26	-0.19%	589	500	-1,089	-699	-390

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터