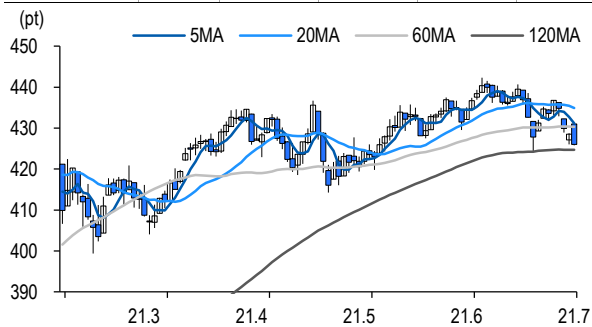


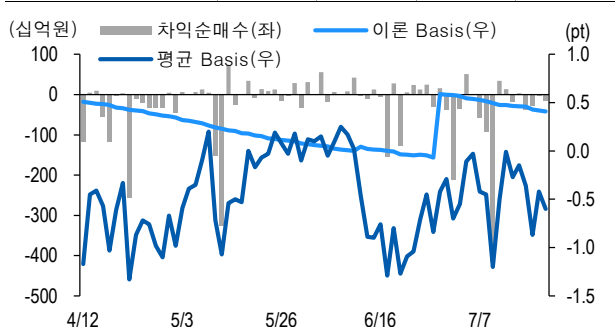
선물옵션시장 지표

2021.7.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	426.00	-0.60	-2.55	10,092.0	-
선물 9월물	425.65	-0.67	-2.85	24,252.0	252,247
선물 12월물	425.15	-0.67	-2.85	28.7	28,970
8월물(mini)	425.68	-0.66	-2.84	2,272.9	47,925
9월물(mini)	425.48	-0.70	-2.90	6.0	7,833



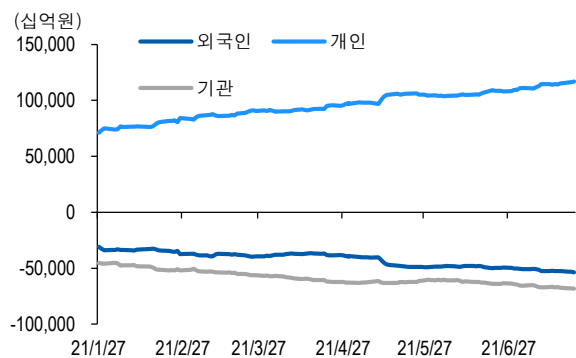
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.41	-0.60	-0.35	-0.24%
베이스(mini)	0.18	-0.45	-0.32	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.50	-0.50	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.18	-0.26	-0.26	-0.10%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-507.3	-9.7	-517.0	-10.2	-447.1	-821.8	-13.8	-2.7	0.4	-27.2
개인	744.9	61.7	806.7	0.0	-2.6	203.9	54.6	0.2	0.6	-60.4
기관	-274.8	-43.6	-318.4	-5.3	2.0	616.3	-58.6	2.9	-1.2	90.7
금융투자	-169.2	-108.3	-277.5	-3.1	-5.9	500.6	-58.7	3.0	-1.3	57.7
투신	11.1	0.8	11.8	0.0	21.0	111.1	0.0	0.0	0.2	20.2
은행+보험+기타금융	-26.4	61.2	34.9	0.0	-17.1	3.2	0.0	0.0	0.0	3.3
연기금+국가지자체	-100.7	-0.2	-100.9	-2.2	-5.4	1.4	0.1	0.0	0.0	9.5
기타법인	37.2	-8.5	28.8	0.0	0.6	1.7	17.8	-0.5	0.1	-3.2

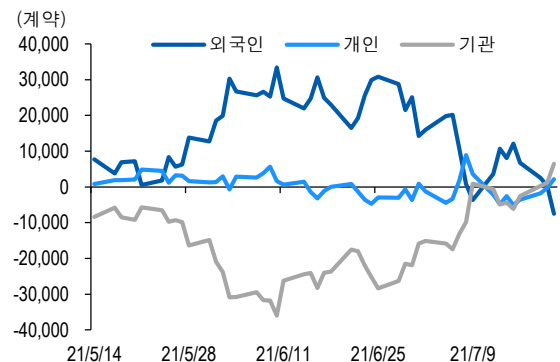
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



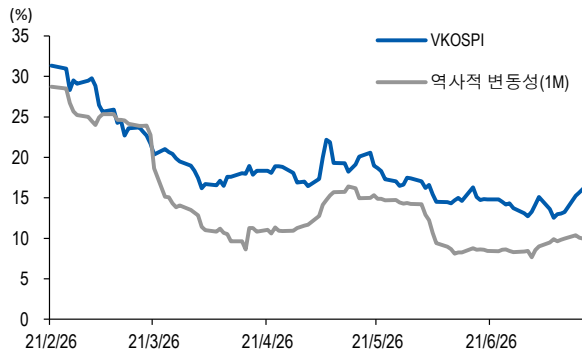
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	516,141	166.0	651,382	12.6%	지수옵션 전체	1,154,806	424.6	1,797,123
Put	638,665	258.6	1,145,741	15.2%	PCR(금액기준)	1.56	VKOSPI	16.12%(+0.44%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	2.12	-0.88	49,950	16,637	3,872	12.6	Put	430.0(K+1)	8.13	1.49	4,490	8,773	41	14.1
	432.5(K+2)	2.91	-1.11	23,351	7,242	2,020	12.8		427.5(K+0)	6.82	1.29	6,777	7,285	27	14.4
	430.0(K+1)	3.87	-1.34	15,389	6,975	966	13.0		425.0(K-1)	5.68	1.09	16,436	12,154	996	14.7
	427.5(K+0)	5.06	-1.55	6,344	2,980	509	13.3		422.5(K-2)	4.71	0.93	15,802	5,729	42	15.0
	425.0(K-1)	6.42	-1.75	2,861	2,359	-2	13.6		420.0(K-3)	3.89	0.72	48,553	15,939	110	15.4

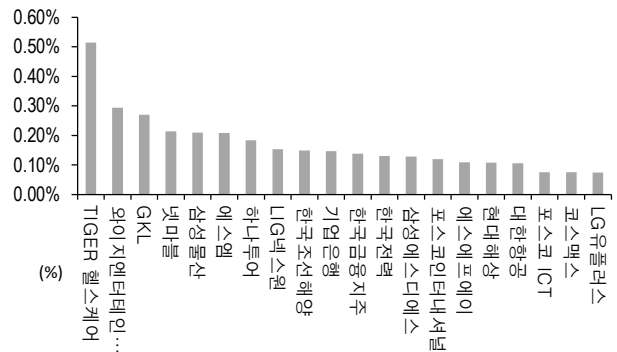
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,858,952	3,588.3	6,402,091	22,431	-9,666	-18,487	25,832	-27.2	-60.4	90.7	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	734,000	0.55	131.4	89.9	42,413	-1,549	-0.01%	-214	-713	962	343	1,474
NAVER	427,000	-2.95	322.8	84.4	93,457	-4,087	-0.04%	609	-1,379	859	3,063	1,938
엔씨소프트	807,000	-1.71	49.3	82.0	6,980	204	-0.08%	94	275	-355	19	-223
기아	87,200	0.00	90.9	76.3	96,798	-163	0.00%	-4,041	1,840	2,201	3,203	-904
LG 이노텍	234,500	-0.85	19.0	71.8	14,608	50	0.01%	-56	245	-189	26	-185
하나금융지주	42,200	0.24	30.3	68.4	145,923	-1,521	-0.02%	-88	-796	855	-1,395	2,250
삼성생명	75,700	0.26	12.2	68.1	27,434	872	0.03%	1,954	166	-2,118	-1,836	-288
현대차	227,500	0.22	95.2	65.9	64,603	2,929	-0.08%	-3,335	1,058	1,877	507	370
SK 이노베이션	259,000	-0.19	66.7	61.8	31,656	139	-0.05%	-2,295	-127	2,388	1,454	97
LG 화학	809,000	-0.49	73.1	61.5	15,717	-223	-0.11%	-420	-182	602	15	341

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터