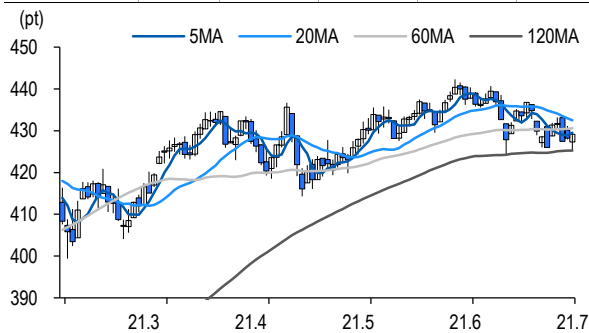


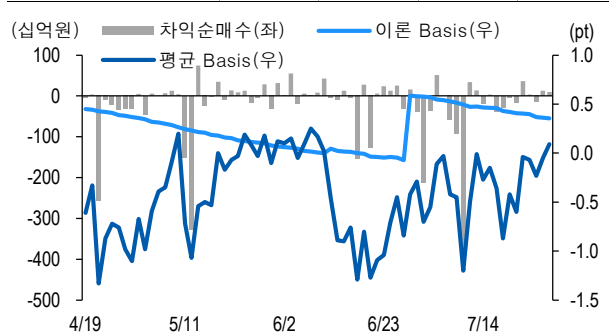
선물옵션시장 지표

2021.7.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.15	0.22	0.93	8,089.1	-
선물 9월물	428.65	0.12	0.50	29,499.4	249,005
선물 12월물	428.25	0.14	0.60	40.0	29,114
8월물(mini)	428.64	0.11	0.46	2,613.2	65,942
9월물(mini)	429.00	0.20	1.02	9.2	14,530



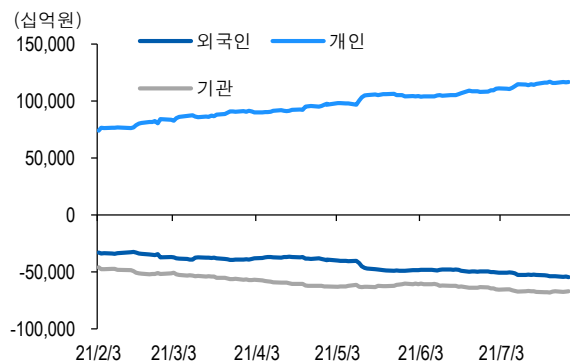
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.35	0.09	-0.50	-0.06%
베이스(mini)	0.12	0.00	-0.51	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.57	-0.55	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.12	-0.51	-0.51	-0.15%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-421.3	-9.9	-431.1	0.0	-111.2	275.7	-17.6	-0.5	1.7	31.3
개인	136.8	94.7	231.5	0.0	-8.8	-28.2	-27.3	-2.1	0.4	-35.8
기관	303.1	-77.3	225.8	9.7	3.0	-264.4	46.2	2.9	-2.3	4.5
금융투자	412.2	-169.2	243.1	5.5	-0.8	-273.6	46.2	2.9	-2.2	42.3
투신	-18.6	-20.2	-38.8	0.0	-2.3	19.6	0.0	0.0	0.1	-42.0
은행+보험+기타금융	-6.7	86.5	79.9	0.0	-1.2	-3.3	0.0	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	-67.4	19.9	-47.5	4.2	6.2	-7.2	0.0	0.0	0.0	4.1
기타법인	-18.7	-7.5	-26.2	0.0	0.6	16.9	-1.3	-0.3	0.2	0.0

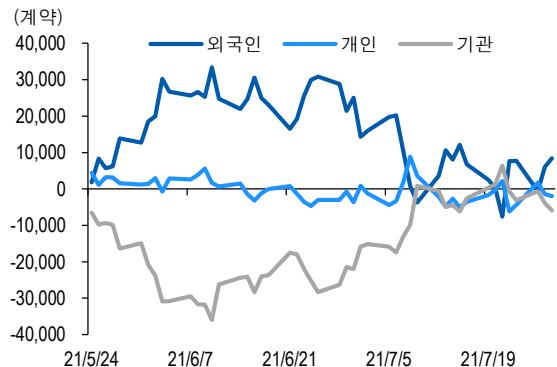
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



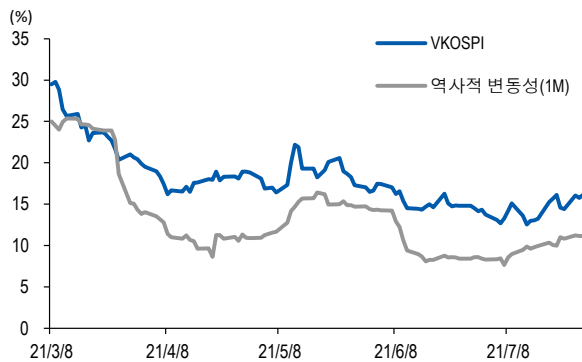
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	724,777	221.9	704,239	12.3%	지수옵션 전체	1,701,701	554.7	1,958,447
Put	976,924	332.8	1,254,208	15.8%	PCR(금액기준)	1.50	VKOSPI	16.11%(+0.36%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	2.13	0.09	99,533	18,596	1,022	12.2	Put	430.0(K+1)	5.54	-0.31	9,591	11,572	-8	14.4
	432.5(K+2)	3.05	0.17	58,504	11,002	1,427	12.4		427.5(K+0)	4.41	-0.27	14,321	10,045	423	14.7
	430.0(K+1)	4.16	0.18	29,018	10,453	1,596	12.6		425.0(K-1)	3.52	-0.21	34,816	16,688	883	15.1
	427.5(K+0)	5.55	0.22	11,830	5,091	1,082	12.9		422.5(K-2)	2.79	-0.16	34,599	8,123	151	15.6
	425.0(K-1)	7.15	0.29	5,061	4,468	193	13.2		420.0(K-3)	2.21	-0.14	75,662	19,637	275	16.0

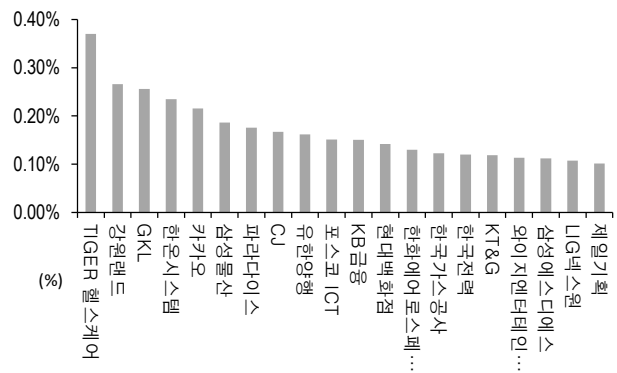
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,742,603	3,650.7	6,483,587	12,816	79,646	-38,104	-45,005	31.3	-35.8	4.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,850	1.70	54.4	130.0	154,728	8,700	0.07%	3,918	-3,272	-482	-6,362	-7,806
SK 텔레콤	310,000	2.31	58.4	101.8	17,044	1,874	0.00%	1,441	62	-1,496	-269	-1,312
하나투어	75,300	-1.44	6.9	100.9	5,814	-1,034	-0.37%	413	65	-478	4,104	48
삼성 SDI	759,000	-0.26	241.7	98.4	44,356	-3,540	-0.01%	-233	-533	741	437	2,525
호텔신라	93,700	0.00	14.8	89.6	22,309	-20	-0.02%	-135	-40	158	492	-304
NAVER	442,500	-2.32	349.9	86.9	88,313	-1,564	-0.04%	1,759	-158	-1,563	-265	2,049
POSCO	365,500	0.41	136.5	86.6	16,845	-554	-0.01%	-1,692	-839	2,506	1,765	-31
롯데케미칼	270,000	0.56	31.7	82.7	11,727	191	0.09%	170	234	-394	-161	-233
LG 화학	833,000	0.24	99.9	80.0	15,958	-292	-0.13%	-133	-640	777	477	-181
KB 금융	52,500	0.57	44.7	77.9	56,211	9,694	0.15%	-538	1,164	-633	232	-9,659

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터