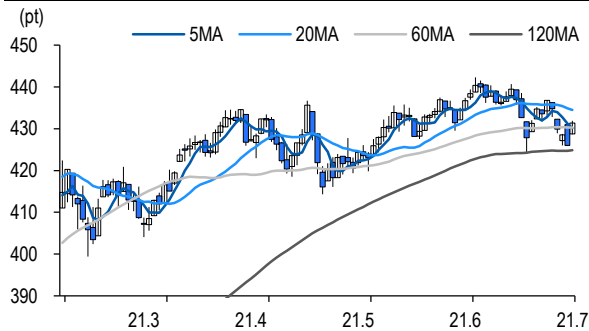


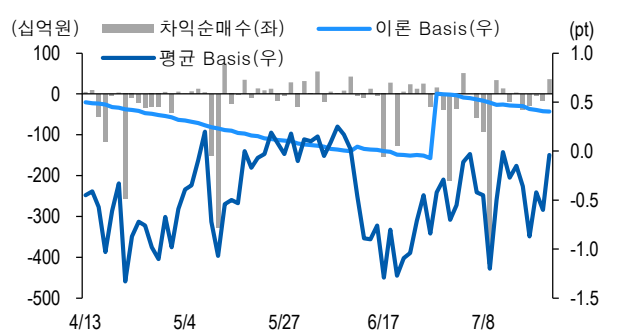
선물옵션시장 지표

2021.7.23

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.38	1.26	5.38	9,072.4	-
선물 9월물	431.50	1.37	5.85	18,176.4	249,151
선물 12월물	430.55	1.27	5.40	25.3	29,000
8월물(mini)	431.50	1.37	5.82	2,062.6	56,728
9월물(mini)	431.30	1.33	5.82	7.2	12,688

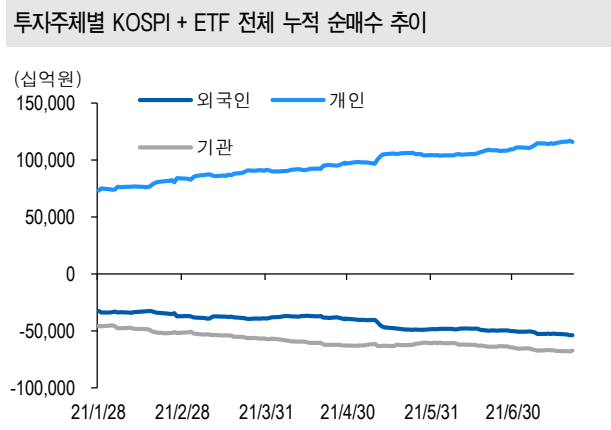


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.41	-0.04	0.12	-0.10%
베이스스(mini)	0.17	-0.06	0.12	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.58	-0.60	-0.17%
합성선물 베이스스(ATM)	0.17	0.03	0.03	-0.03%

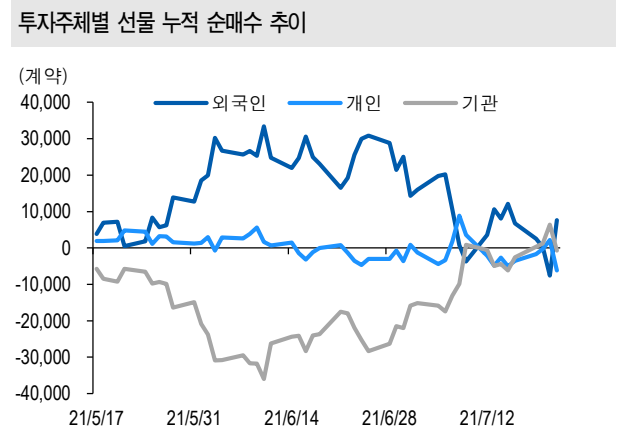


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	60.0	24.2	84.1	0.4	163.7	1,962.7	-332.7	-0.4	2.7	23.0
개인	-880.7	-73.5	-954.2	0.0	-13.0	-776.3	-119.7	-2.7	1.3	-18.5
기관	815.8	42.9	858.7	36.1	-11.1	-1,230.4	463.0	3.4	-1.5	-4.5
금융투자	827.1	18.7	845.8	6.0	-1.0	-1,601.6	462.5	3.5	-1.9	-14.1
투신	4.0	18.1	22.2	0.0	10.2	399.7	0.0	0.0	-0.1	6.4
은행+보험+기타금융	-22.6	26.0	3.4	0.0	-9.5	1.4	0.4	0.0	0.5	-1.3
연기금+국가자자체	6.1	-23.4	-17.3	30.1	-13.1	-29.8	0.2	0.0	0.0	4.4
기타법인	4.9	6.5	11.4	0.0	-0.4	43.9	-10.5	-0.4	-2.5	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

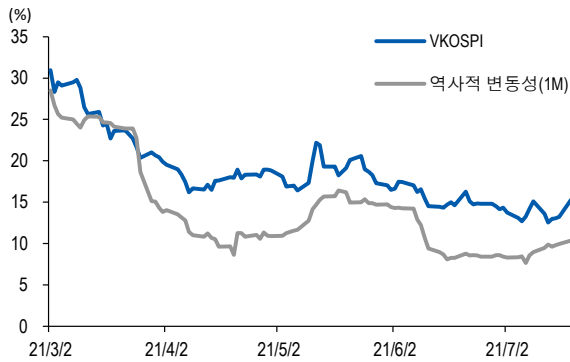
지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	500,554	195.3	660,927	11.9%	지수옵션 전체	951,464	328.6	1,846,523
Put	450,910	133.3	1,185,596	14.3%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	14.60%(-1.52%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	432.5(K+3)	4.60	1.69	18,470	8,263	1,021	12.0	Put	427.5(K+1)	3.73	-3.09	8,148	8,022	737	13.1
	430.0(K+2)	6.03	2.16	9,774	7,045	70	12.4		425.0(K+0)	3.00	-2.68	18,794	13,615	1,461	13.6
	427.5(K+1)	7.65	2.59	4,925	3,504	524	12.8		422.5(K-1)	2.42	-2.29	17,517	6,742	1,013	14.0
	425.0(K+0)	9.41	2.99	4,521	4,118	1,759	13.2		420.0(K-2)	1.97	-1.92	28,989	18,722	2,783	14.6
	422.5(K-1)	11.10	3.15	196	873	-51	12.9		417.5(K-3)	1.54	-1.70	20,845	10,728	1,127	14.9

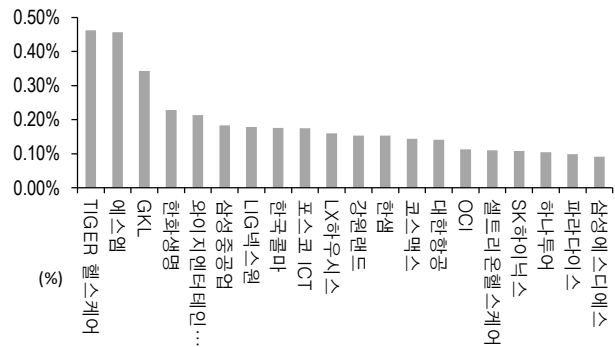
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재물 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,084,521	3,724.2	6,394,287	-7,804	36,135	6,798	-43,168	23.0	-18.5	-4.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재물 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	229,500	0.88	179.1	99.4	64,931	328	0.03%	1,516	1,571	-3,019	3,395	-275
삼성 SDI	739,000	0.68	85.1	88.9	41,454	-959	-0.02%	-594	183	398	631	432
NAVER	440,500	3.16	390.5	86.2	92,907	-550	0.02%	-1,040	-1,946	2,895	2,532	-1,260
기아	87,700	0.57	161.2	83.2	113,408	16,610	0.05%	1,750	5,434	-7,189	-929	-6,211
호텔신라	96,000	4.58	87.9	81.1	27,815	5,815	0.03%	1,353	-3,871	2,660	-3,376	-1,550
LG 이노텍	233,500	-0.43	18.1	78.8	13,945	-663	-0.09%	166	473	-652	284	48
하나금융지주	44,150	4.62	54.6	76.3	165,591	19,668	0.05%	-3,714	-11,545	15,715	-4,014	-7,757
삼성전자	79,600	1.40	761.5	76.1	1,065,811	-10,289	-0.03%	14,126	-5,523	-8,362	-15,811	9,250
카카오	148,500	3.13	529.1	63.3	176,982	-933	0.05%	5,812	-4,998	-861	-1,905	-430
엔씨소프트	794,000	-1.61	51.9	61.4	7,313	333	-0.09%	333	88	-386	114	19

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터