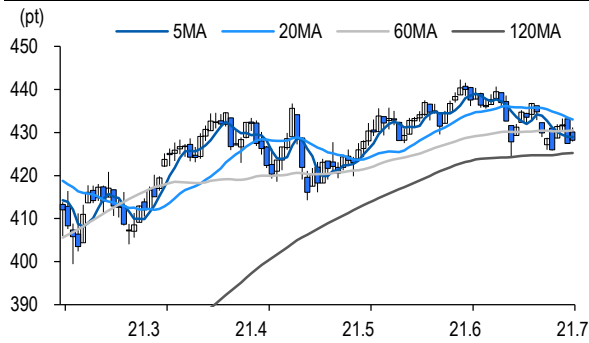


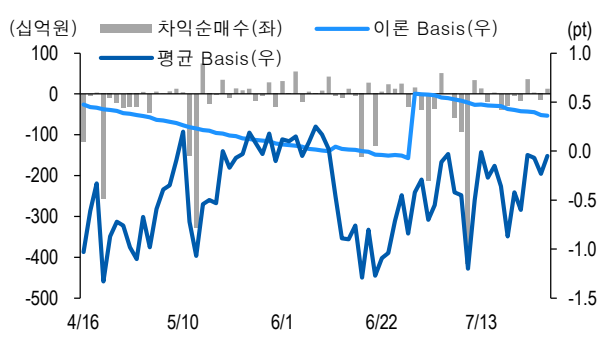
선물옵션시장 지표

2021.7.28

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	428.22	0.18	0.75	7,837.3	-	
선물 9월물	428.15	0.04	0.15	21,036.3	249,414	
선물 12월물	427.65	0.05	0.20	29.5	29,061	
8월물(mini)	428.18	0.06	0.26	1,931.0	61,146	
9월물(mini)	427.98	0.00	0.28	4.9	13,284	

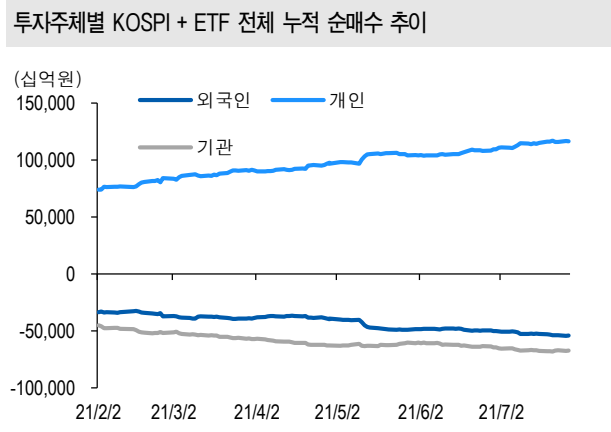


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.36	-0.05	-0.07	-0.10%	
베이스(mini)	0.13	-0.09	-0.04	-0.05%	
제1스프레드(SP)	0.15	-0.53	-0.60	-0.16%	
합성선물 베이스(ATM)	0.13	-0.07	-0.07	-0.05%	

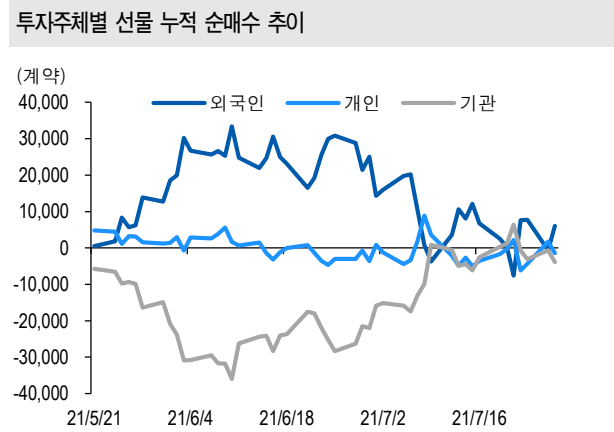


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	44.7	-17.7	27.0	0.0	212.2	850.8	-129.3	2.1	1.4	-14.5	
개인	-280.9	33.6	-247.3	0.0	16.2	-326.1	-17.6	-3.3	0.2	16.5	
기관	226.8	-18.0	208.9	12.7	-17.0	-498.3	146.0	1.5	-1.5	-2.7	
금융투자	236.6	-34.1	202.5	2.5	-22.4	-595.0	145.9	1.6	-1.5	-20.4	
투신	7.2	-13.5	-6.3	0.0	-8.0	189.3	0.0	0.0	0.0	13.3	
은행+보험+기타금융	-7.7	11.2	3.4	-0.5	-6.1	-81.8	0.1	-0.1	0.1	-0.1	
연기금+국가자재	25.4	0.4	25.8	10.8	20.2	-10.8	0.0	0.0	0.0	4.5	
기타법인	9.4	2.1	11.4	0.0	0.3	-26.5	0.9	-0.2	-0.1	0.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

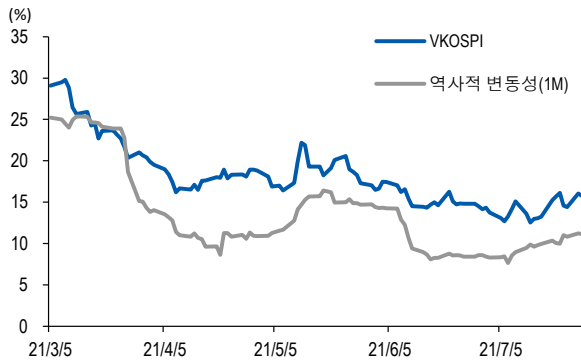
지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	488,221	171.4	697,243	12.4%	지수옵션 전체	1,137,094	370.4	1,930,557
Put	648,873	199.0	1,233,314	14.8%	PCR(금액기준)	1.16	VKOSPI	15.75%(-0.30%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	2.04	-0.18	57,818	17,574	1,090	12.4	Put	430.0(K+1)	5.85	-0.35	8,669	11,580	775	13.5
	432.5(K+2)	2.88	-0.21	28,928	9,575	137	12.6		427.5(K+0)	4.68	-0.37	15,337	9,622	792	13.8
	430.0(K+1)	3.98	-0.22	14,446	8,857	568	12.9		425.0(K-1)	3.73	-0.37	30,522	15,805	134	14.3
	427.5(K+0)	5.33	-0.21	5,633	4,009	-60	13.3		422.5(K-2)	2.95	-0.36	32,796	7,972	186	14.7
	425.0(K-1)	6.86	-0.20	2,386	4,275	-110	13.6		420.0(K-3)	2.35	-0.30	56,691	19,362	617	15.2

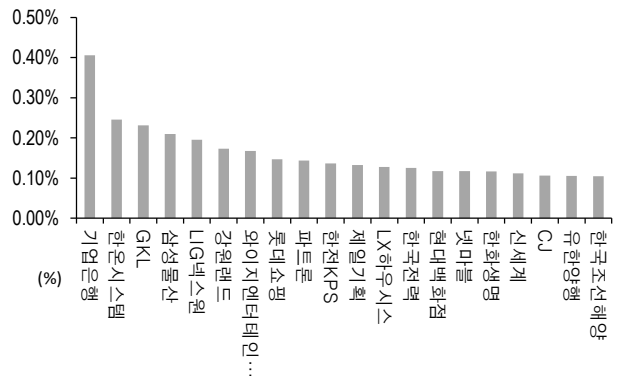
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배출 상위 10종목)

										(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,450,398	3,335.2	6,470,771	39,961	-29,167	53,313	-23,674	-14.5	16.5	-2.7		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배출 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,100	0.23	37.8	126.1	146,028	6,271	0.02%	-6,083	-554	6,656	-1,699	-1,704
엔씨소프트	807,000	-2.06	55.7	86.0	6,748	-163	-0.06%	-298	153	172	363	-101
NAVER	453,000	0.00	287.6	83.6	89,877	-4,278	-0.02%	-610	-1,115	1,722	1,959	1,395
호텔신라	93,700	0.54	18.4	82.1	22,329	-600	-0.01%	283	-543	234	80	154
KT	33,200	-1.34	26.7	80.0	81,987	-1,715	-0.06%	4,671	2,899	-7,585	-2,687	1,606
SK 텔레콤	303,000	-1.46	33.8	79.3	15,170	-295	-0.12%	-1,910	225	1,667	473	1,224
삼성 SDI	761,000	2.98	249.6	76.3	47,896	1,124	0.07%	-315	-558	843	-880	592
기아	86,300	0.35	71.7	69.8	102,065	2,614	0.02%	6,724	-2,627	-4,089	836	-5,111
LG 유플러스	14,600	-0.34	7.9	69.1	118,942	4,838	-0.20%	-11,026	1,704	9,226	9,226	0
LG 전자	162,500	-0.31	48.0	69.0	55,245	-8,067	-0.13%	2,125	-608	-1,681	-1,424	1,410

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터