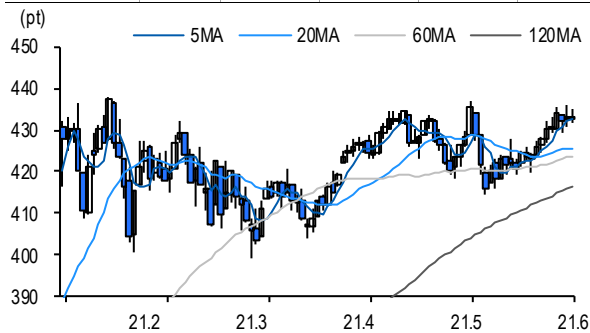


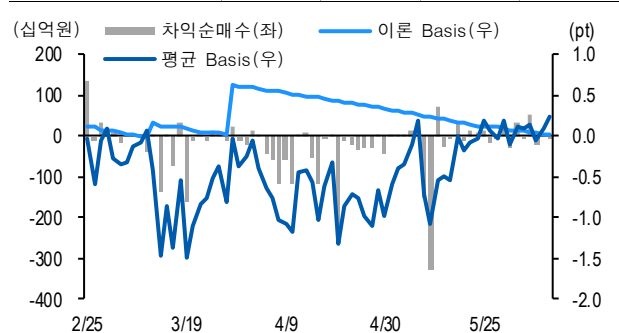
선물옵션시장 지표

2021.6.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	432.88	-0.09	-0.38	12,326.7	-
선물 6월물	432.95	-0.16	-0.70	23,125.7	163,044
선물 9월물	432.20	-0.22	-0.95	1,568.4	153,708
6월물(mini)	433.04	-0.14	-0.54	1,435.0	48,729
7월물(mini)	432.00	-0.16	-0.70	19.1	10,842



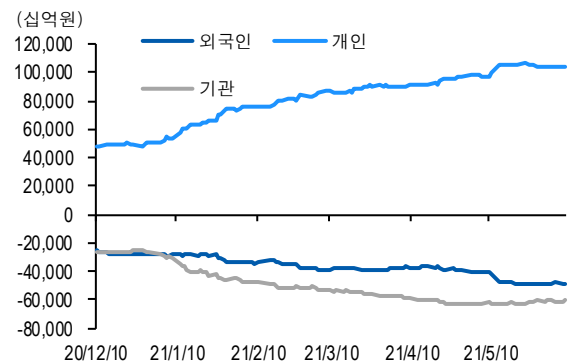
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.02	0.25	0.07	0.05%
베이스(mini)	0.02	0.25	0.16	0.05%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.58	-0.65	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	0.07	0.07	0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-206.4	-19.1	-225.5	0.3	-209.2	146.7	-37.5	24.9	8.2	-42.4
개인	-44.6	39.2	-5.4	0.0	-0.5	96.0	37.9	0.6	-2.7	117.2
기관	261.9	-24.4	237.5	-0.4	-65.2	-232.8	-2.3	1.1	0.8	-73.4
금융투자	373.5	-15.2	358.3	1.8	-17.7	-195.6	-1.6	1.4	0.8	-80.2
투신	7.1	-1.8	5.3	4.3	-22.8	-63.6	0.0	-0.3	-0.1	-5.9
은행+보험+기타금융	-10.7	-11.2	-22.0	0.0	-4.3	18.6	-0.6	0.0	0.0	0.4
연기금+국가자재	-90.0	2.9	-87.1	-6.5	-19.9	7.8	0.0	0.0	0.0	12.3
기타법인	-10.9	4.3	-6.6	0.0	1.3	-9.9	1.9	-26.6	-6.3	-1.3

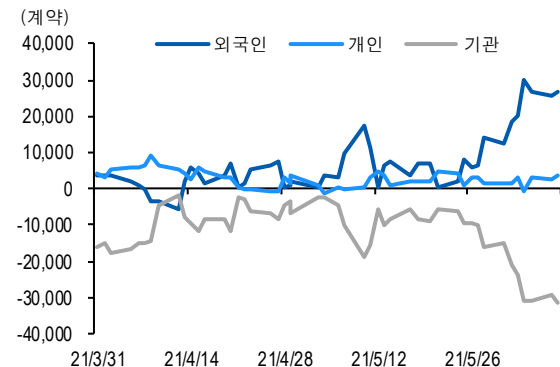
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,352,101	292.4	912,715	14.5%	지수옵션 전체	2,581,151	515.5	2,724,779
Put	1,229,050	223.1	1,812,064	15.9%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	16.24%(-0.80%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	0.29	-0.46	261,100	33,570	2,330	14.4	Put	435.0(K+1)	3.48	-0.14	36,416	8,387	1,485	14.5
	437.5(K+2)	0.70	-0.64	190,126	21,347	2,904	14.6		432.5(K+0)	2.10	-0.33	112,799	13,558	2,332	14.7
	435.0(K+1)	1.42	-0.82	150,058	21,267	-75	14.8		430.0(K-1)	1.17	-0.40	170,436	22,153	3,276	15.0
	432.5(K+0)	2.55	-0.95	68,712	19,778	3,092	15.0		427.5(K-2)	0.67	-0.30	217,554	19,139	1,353	16.0
	430.0(K-1)	4.13	-1.04	20,025	19,734	42	15.4		425.0(K-3)	0.36	-0.25	177,607	24,840	962	16.8

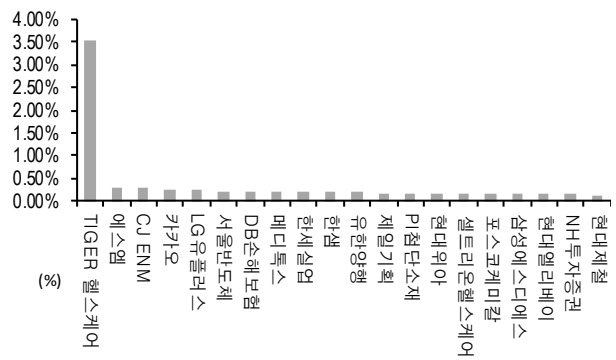
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	7,546,292	4,804.7	7,934,874	19,259	-151,959	345,685	-192,827	-42.4	117.2	-73.4	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	46,950	-0.21	42.4	121.5	144,413	-8,942	0.01%	-601	-1,034	1,525	1,965	2,667
호텔신라	97,500	0.10	41.2	99.1	26,461	-7,262	-0.04%	265	-262	-3	1,393	61
SK 텔레콤	328,000	1.39	74.5	84.4	11,862	-488	0.06%	93	28	-127	12	-96
SK 하이닉스	127,500	-1.16	416.4	78.8	169,062	-23,690	-0.14%	-768	-11,650	12,704	12,376	3,800
삼성전자	82,000	-0.12	811.6	77.8	935,430	-92,824	0.03%	-11,082	49,515	-38,632	-42,600	4,613
엔씨소프트	849,000	0.35	27.7	75.2	3,284	-258	-0.03%	-277	290	-13	-24	79
현대차	244,000	1.24	135.6	64.0	70,107	-6,384	0.09%	6,107	-1,912	-4,157	-1,497	-1,656
기아	91,600	1.78	205.7	62.1	169,509	1,469	0.09%	4,969	-2,123	-2,837	5,353	-16,614
신한지주	42,700	-0.23	30.1	61.4	66,885	-3,594	0.05%	-3,165	-2,878	6,043	7,285	-1,172
LG 디스플레이	23,500	-0.42	40.7	60.1	262,401	-103,306	0.04%	2,163	6,654	-8,827	-4,613	8,567

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터