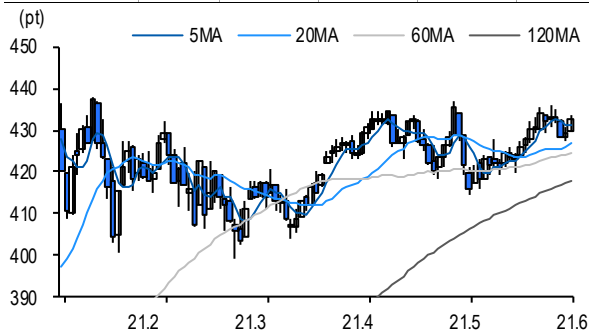


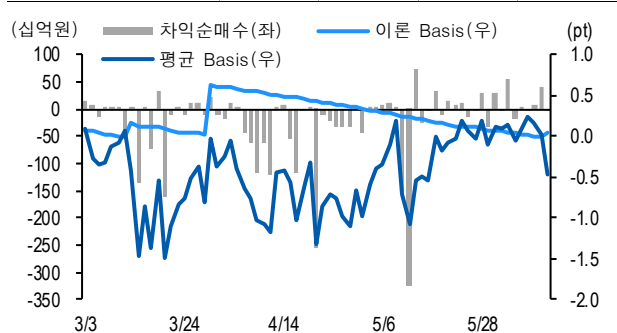
선물옵션시장 지표

2021.6.14

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	432.78	0.80	3.43	12,612.3	-
선물 9월물	432.05	0.75	3.20	23,116.7	217,296
선물 12월물	431.80	0.69	2.95	11.3	27,823
7월물(mini)	431.80	0.75	3.22	1,785.0	27,378
8월물(mini)	432.06	0.75	3.20	1.8	163



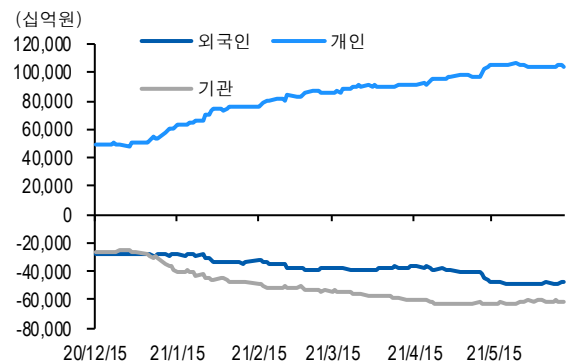
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.04	-0.46	-0.73	-0.12%
베이스(mini)	-0.45	-0.66	-0.98	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.47	-0.50	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	-0.45	-0.95	-0.95	-0.12%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	176.4	2.3	178.7	0.1	126.0	60.8	-13.6	-0.5	1.1	-13.2
개인	-471.3	-76.4	-547.7	0.0	5.4	35.2	-6.1	-2.5	-2.1	168.8
기관	266.7	72.1	338.8	-3.4	29.0	-100.1	21.5	3.1	1.3	-157.0
금융투자	-31.3	117.6	86.3	-3.4	-0.6	-207.2	21.6	3.5	2.3	-58.9
투신	104.1	-56.5	47.5	0.0	13.6	95.9	-0.1	-0.4	-0.3	10.6
은행+보험+기타금융	2.3	18.6	20.9	0.0	-11.9	8.7	-0.1	0.1	-0.7	0.0
연기금+국가자재	172.0	-5.9	166.1	0.0	24.6	2.5	0.0	0.0	0.0	-108.7
기타법인	28.2	2.0	30.2	0.0	2.4	4.2	-1.9	-0.1	-0.3	1.5

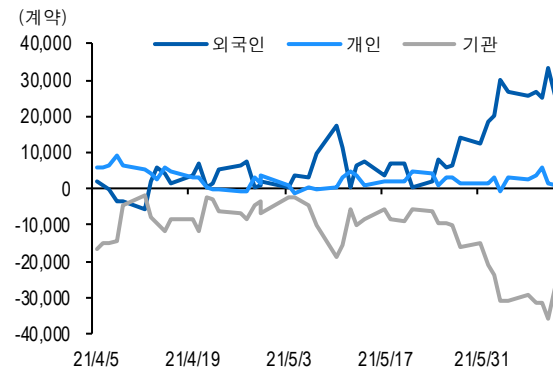
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	458,245	185.6	438,735	12.4%	지수옵션 전체	956,832	349.2	1,189,610
Put	498,587	163.6	750,875	14.1%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	14.51%(-0.93%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	3.71	0.59	21,670	5,006	1,717	12.4	Put	432.5(K+1)	6.58	-2.12	4,440	1,482	730	13.6
	435.0(K+2)	4.70	0.76	8,182	5,370	1,139	12.4		430.0(K+0)	5.38	-2.00	7,147	3,247	736	13.6
	432.5(K+1)	5.90	1.06	6,772	3,964	1,260	12.5		427.5(K-1)	4.40	-1.76	4,603	2,013	228	13.8
	430.0(K+0)	7.21	1.20	5,040	4,624	336	12.5		425.0(K-2)	3.61	-1.51	9,257	6,177	676	14.0
	427.5(K-1)	8.75	1.42	2,004	1,455	329	12.7		422.5(K-3)	2.94	-1.32	14,750	3,220	1,431	14.3

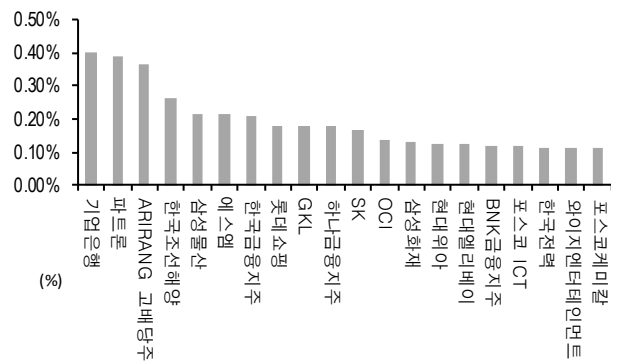
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,058,042	3,294.2	6,469,483	363,984	27,843	219,100	-257,519	-13.2	168.8	-157.0			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	98,900	-0.80	37.9	90.3	43,888	50	-0.01%	-1,434	-621	2,041	2,169	669
LG 이노텍	211,000	0.24	16.6	74.7	8,937	1,407	-0.11%	-1,122	1,380	-268	-269	-260
현대차	238,500	0.00	105.4	64.0	94,544	1,711	-0.24%	2,500	1,048	-3,557	-3,828	-196
NAVER	374,000	-0.13	149.1	60.7	56,204	-1,152	-0.01%	-1,830	210	1,587	2,857	-756
KT	33,100	-0.45	19.9	59.1	82,229	9,910	0.02%	-531	8,644	-8,213	-2,178	-5,662
하나금융지주	45,450	-0.44	23.9	57.7	145,900	1,949	0.18%	622	3,534	-4,173	-3,113	-1,060
삼성전자	80,800	0.00	651.9	57.1	1,324,595	73,326	0.09%	-21,848	88,940	-66,796	-23,175	-31,000
삼성전기	176,500	0.57	29.8	55.0	24,519	1,082	0.11%	277	1,011	-1,289	-968	-516
기아	89,700	0.11	114.7	52.9	157,789	6,193	0.03%	-2,940	6,217	-3,110	1,120	-5,298
삼성물산	141,000	-0.35	18.0	49.6	60,222	2,150	0.22%	-1,884	2,877	-998	258	-1,265

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터