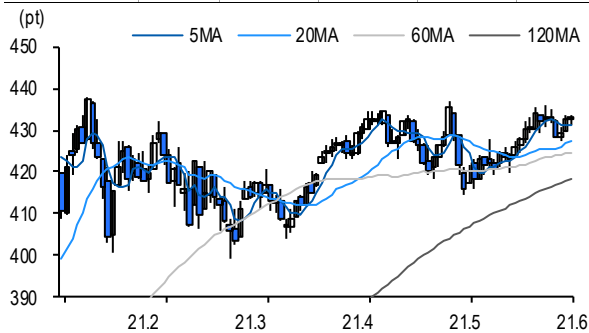


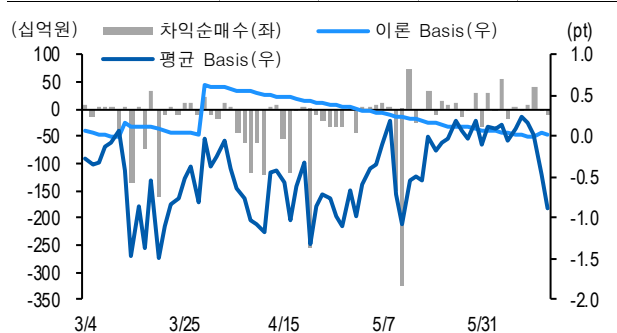
선물옵션시장 지표

2021.6.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	433.22	0.10	0.44	9,518.7	-
선물 9월물	432.30	0.06	0.25	12,924.6	220,458
선물 12월물	431.75	-0.01	-0.05	5.8	27,816
7월물(mini)	432.22	0.10	0.42	1,287.4	29,909
8월물(mini)	432.26	0.05	0.20	1.6	171



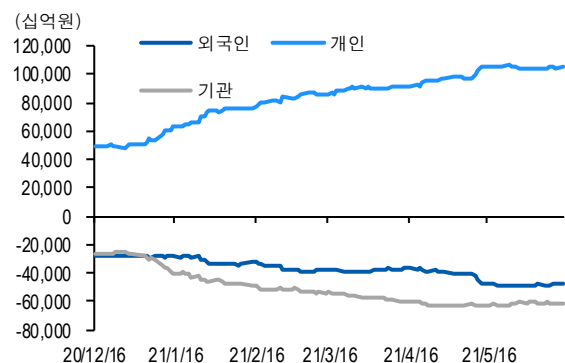
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.02	-0.89	-0.92	-0.21%
베이스(mini)	-0.47	-0.99	-1.00	-0.12%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.51	-0.50	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-0.47	-1.04	-1.04	-0.13%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-24.3	-1.1	-25.4	0.0	-81.0	-337.2	39.6	-2.2	-2.4	-11.7
개인	353.8	-3.4	350.4	0.0	-2.8	90.4	-7.9	1.9	-0.2	1.4
기관	-332.0	7.2	-324.8	-10.0	2.0	229.6	-34.0	0.1	2.8	11.8
금융투자	-255.6	40.0	-215.5	1.4	-3.2	223.0	-34.2	0.3	2.8	10.6
투신	-20.4	-10.5	-30.9	0.0	-5.6	-44.4	0.0	-0.1	-0.1	-21.0
은행+보험+기타금융	-7.9	-15.2	-23.1	-0.6	3.6	16.0	0.1	-0.1	0.1	-0.7
연기금+국가지자체	-17.3	0.3	-16.9	-10.8	26.8	35.0	0.1	0.0	0.0	22.8
기타법인	2.6	-2.7	-0.1	0.0	1.2	17.2	2.3	0.1	-0.2	-1.5

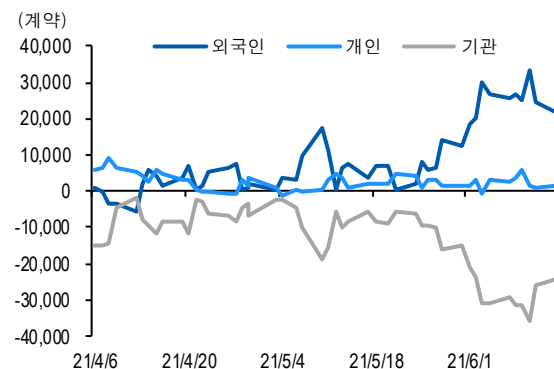
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	251,582	91.8	464,604	12.0%	지수옵션 전체	535,361	186.3	1,266,508
Put	283,779	94.5	801,904	13.8%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	14.46%(-0.05%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	2.63	-0.30	21,613	8,631	1,408	12.1	Put	435.0(K+1)	7.21	-0.66	1,424	1,403	44	13.3
	437.5(K+2)	3.43	-0.28	12,547	5,345	339	12.1		432.5(K+0)	5.87	-0.71	3,942	2,540	1,058	13.3
	435.0(K+1)	4.40	-0.30	6,438	6,807	1,437	12.0		430.0(K-1)	4.76	-0.62	4,896	3,992	745	13.4
	432.5(K+0)	5.55	-0.35	5,169	5,076	1,112	12.0		427.5(K-2)	3.87	-0.53	3,321	2,428	415	13.7
	430.0(K-1)	6.98	-0.23	2,370	4,810	186	12.2		425.0(K-3)	3.11	-0.50	14,452	7,785	1,608	13.9

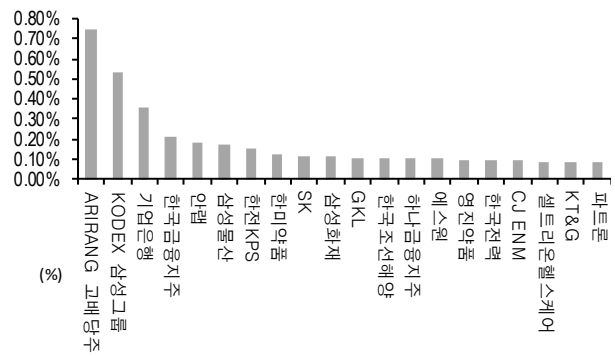
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,428,338	2,943.5	6,524,776	55,293	-13,077	83,873	-67,054	-11.7	1.4	11.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	860,000	2.26	38.2	80.1	3,386	-42	-0.02%	512	-401	-105	-90	-251
현대차	237,500	-0.42	85.1	64.0	97,462	2,918	-0.30%	770	4,220	-5,072	-2,958	-1,144
SK 텔레콤	332,500	-0.45	33.8	63.8	9,384	195	-0.06%	-379	-238	662	406	173
호텔신라	99,000	0.10	22.2	61.2	44,607	719	0.04%	-1,125	798	465	-278	-2,073
아모레퍼시픽	278,000	1.46	14.1	60.6	9,930	-592	-0.10%	570	-217	-349	-569	-782
기아	88,500	-1.34	114.0	60.0	153,080	-4,709	0.00%	4,834	1,090	-5,696	6,220	-3,138
SK 하이닉스	127,500	0.00	144.4	56.4	170,214	-12,199	-0.17%	-4,080	4,296	-191	4,723	2,900
하나금융지주	44,550	-1.98	29.4	53.3	153,319	7,419	0.10%	-8,899	10,921	-2,728	408	619
카카오	142,000	4.80	461.9	52.7	213,848	-683	-0.17%	-2,664	-4,596	7,338	11,694	2,480
LG 전자	157,500	3.62	142.7	52.5	49,502	2,459	0.06%	2,567	-5,007	2,345	5,844	-4,970

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터