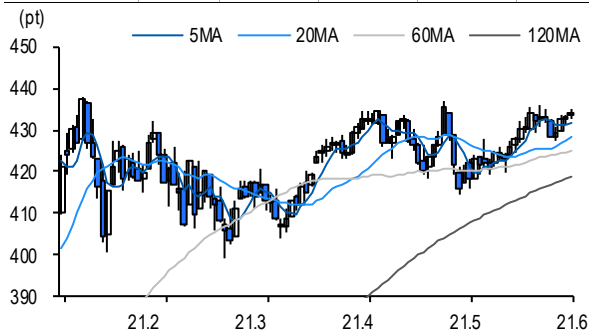


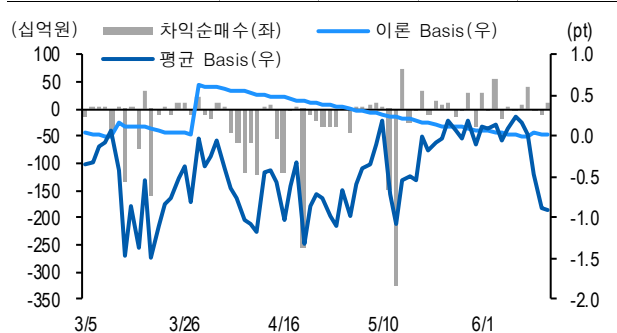
## 선물옵션시장 지표

2021.6.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.13	0.21	0.91	9,563.4	-
선물 9월물	433.45	0.27	1.15	16,471.7	221,278
선물 12월물	432.95	0.28	1.20	6.8	27,818
7월물(mini)	433.44	0.28	1.22	1,771.7	35,402
8월물(mini)	433.16	0.21	0.90	1.5	207



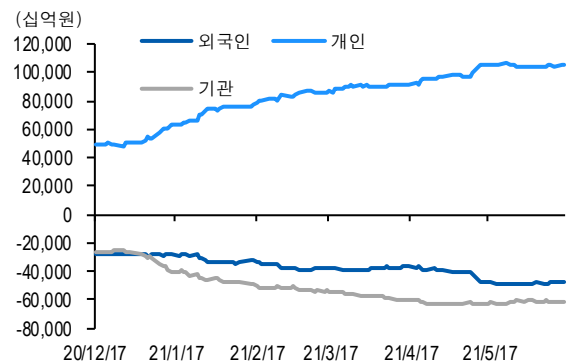
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.02	-0.90	-0.68	-0.21%
베이스(mini)	-0.48	-1.02	-0.69	-0.12%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.57	-0.50	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.48	-0.79	-0.79	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-155.1	-9.4	-164.5	0.0	-159.5	285.0	8.6	1.4	-2.5	-42.2
개인	199.4	33.1	232.5	0.0	-6.3	-311.1	0.7	0.3	-0.1	37.9
기관	-43.5	-25.0	-68.4	12.9	37.6	38.4	-3.6	-1.7	2.8	3.3
금융투자	-37.8	10.0	-27.8	4.3	2.6	-114.2	-3.6	-1.7	2.5	-2.7
투신	-3.4	-4.1	-7.5	0.0	6.5	134.9	0.0	0.0	0.0	20.4
은행+보험+기타금융	-22.3	-22.0	-44.3	0.0	-8.4	33.3	0.1	0.0	0.4	-0.8
연기금+국가자재	80.7	-4.4	76.4	8.6	57.5	-15.5	0.0	0.0	0.0	-13.6
기타법인	-0.9	1.3	0.4	0.0	3.5	-12.3	-5.7	0.1	-0.2	0.9

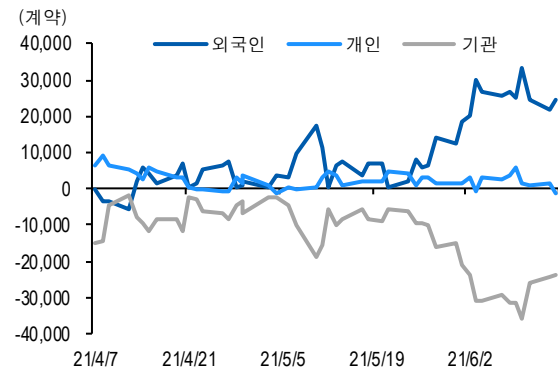
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	300,348	119.9	487,884	12.1%	지수옵션 전체	626,058	226.2	1,337,586
Put	325,710	106.3	849,702	13.7%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	14.33%(-0.13%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	2.83	0.20	28,314	9,683	1,052	12.1	Put	435.0(K+1)	6.44	-0.77	2,946	1,832	429	12.9
	437.5(K+2)	3.75	0.32	17,185	6,517	1,172	12.2		432.5(K+0)	5.22	-0.65	5,132	3,917	1,377	13.1
	435.0(K+1)	4.76	0.36	8,423	7,401	594	12.2		430.0(K-1)	4.21	-0.55	5,136	4,726	734	13.3
	432.5(K+0)	6.06	0.51	6,906	5,945	869	12.3		427.5(K-2)	3.37	-0.50	9,274	3,069	641	13.5
	430.0(K-1)	7.54	0.56	1,750	4,799	-11	12.5		425.0(K-3)	2.68	-0.43	15,224	8,557	772	13.8

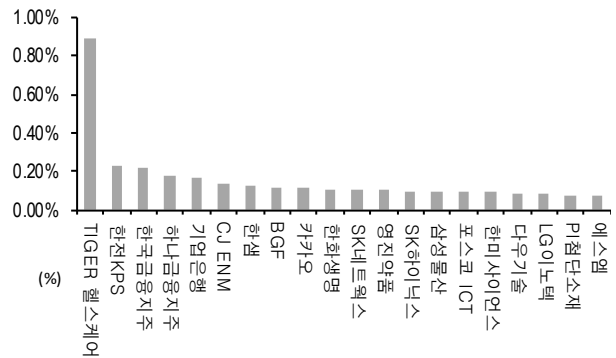
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이시스 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	3,267,535	2,867.6	6,662,849	138,073	-2,799	63,255	-61,557	-42.2	37.9	3.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아	88,500	0.00	103.7	79.2	163,235	10,155	0.07%	3,360	2,490	-5,847	-1,078	-8,276
SK 텔레콤	328,500	-1.20	35.1	75.6	9,898	514	-0.14%	-558	211	345	-22	367
엔씨소프트	856,000	-0.47	25.3	74.5	3,290	-96	0.03%	-301	41	259	-109	-25
현대차	237,000	-0.21	81.9	73.6	98,147	685	-0.32%	-11,449	1,002	10,491	9,651	820
호텔신라	98,800	-0.20	26.3	70.9	45,951	1,344	0.02%	3,480	-370	-3,111	-1,576	-1,535
삼성전자	80,700	0.37	549.8	69.1	1,308,232	22,602	0.01%	-5,129	21,823	-16,774	-9,549	-3,600
NAVER	387,500	0.00	149.7	62.2	56,010	-1,886	-0.07%	-3,084	1,025	1,972	1,942	1,107
하나금융지주	44,450	-0.22	18.6	54.5	154,873	1,554	0.18%	6,637	293	-6,918	-4,501	-2,417
POSCO	340,500	-0.58	70.2	53.7	17,241	443	-0.56%	422	398	-918	-757	-164
LG 이노텍	224,000	2.05	55.4	52.9	14,867	3,482	0.08%	1,166	589	-1,713	-2,382	-835

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터