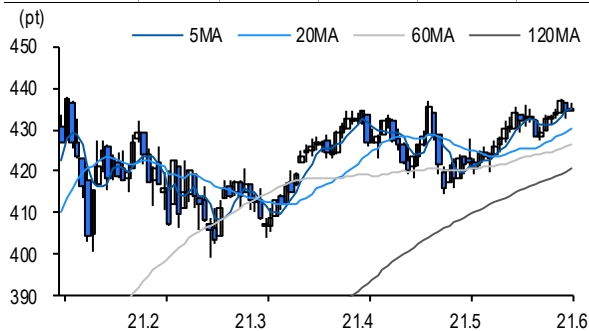


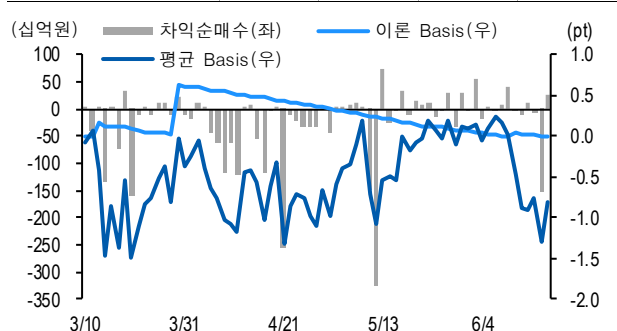
선물옵션시장 지표

2021.6.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	435.02	0.07	0.29	11,554.8	-
선물 9월물	434.50	0.38	1.65	16,234.1	224,295
선물 12월물	434.00	0.28	1.20	11.6	28,452
7월물(mini)	434.30	0.36	1.54	1,583.5	52,921
8월물(mini)	434.22	0.19	0.82	1.8	394



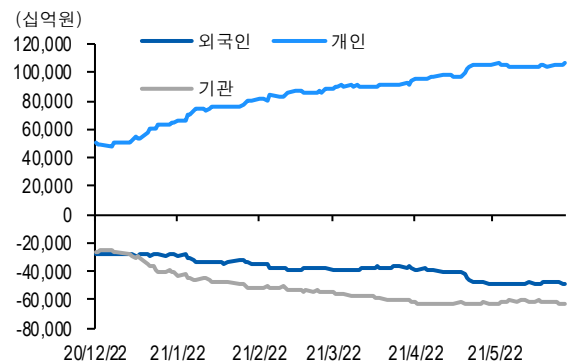
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.01	-0.80	-0.52	-0.18%
베이스(mini)	-0.50	-0.98	-0.72	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.45	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	-0.50	-0.84	-0.84	-0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-823.0	5.4	-817.5	-10.3	-545.2	-139.3	-59.4	-3.1	0.2	0.7
개인	885.2	-73.3	811.9	0.0	-17.8	111.7	10.0	2.2	-0.5	4.5
기관	-62.0	67.2	5.2	38.0	-87.4	-16.5	43.3	0.7	0.3	-8.4
금융투자	198.5	99.9	298.4	-0.9	-25.4	-139.5	46.5	0.8	0.3	49.1
투신	-37.3	1.2	-36.1	0.0	1.0	172.6	-3.3	0.0	0.0	-37.5
은행+보험+기타금융	-79.3	-43.0	-122.2	0.0	-30.2	-13.3	0.1	-0.1	0.0	0.9
연기금+국가지자체	-17.1	0.6	-16.5	38.9	-23.2	-36.3	0.0	0.0	0.0	-20.9
기타법인	-0.3	0.7	0.5	0.0	2.0	44.2	6.0	0.2	0.0	3.2

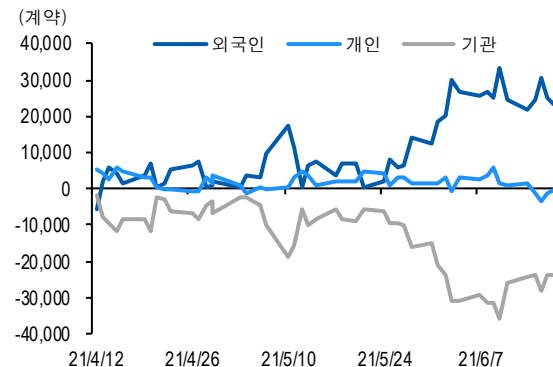
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



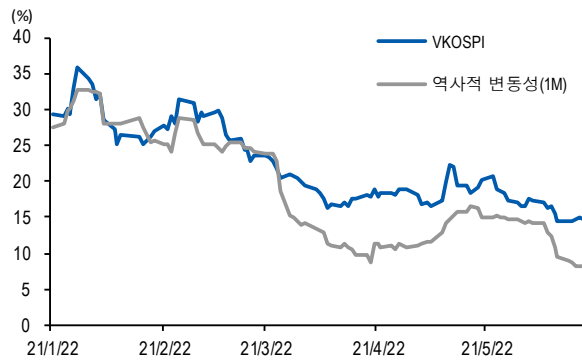
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	360,680	126.8	544,800	12.1%	지수옵션 전체	739,388	240.5	1,512,547
Put	378,708	113.7	967,747	13.8%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	14.62%(-0.36%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	2.07	0.13	39,307	13,222	323	12.1	Put	437.5(K+1)	7.00	-1.07	1,764	1,380	192	12.9
	440.0(K+2)	2.77	0.16	29,177	11,312	749	12.0		435.0(K+0)	5.67	-1.04	5,960	3,324	291	13.1
	437.5(K+1)	3.76	0.29	14,623	10,332	2,114	12.2		432.5(K-1)	4.50	-0.97	5,875	5,695	-240	13.2
	435.0(K+0)	4.85	0.38	8,075	9,111	386	12.2		430.0(K-2)	3.65	-0.79	9,309	6,323	415	13.6
	432.5(K-1)	6.27	0.56	3,054	6,665	-645	12.5		427.5(K-3)	2.90	-0.69	15,064	5,189	991	13.9

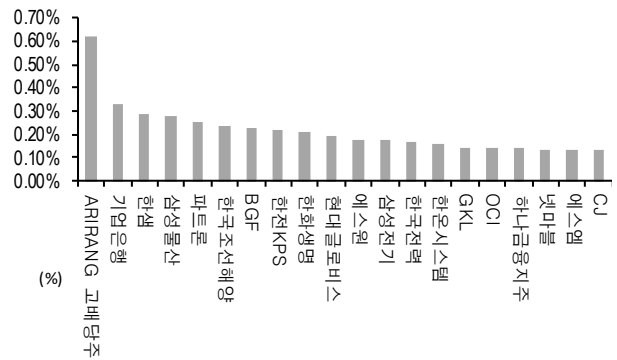
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배울 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	3,467,591	3,105.4	7,141,621	46,906	-14,327	3,749	4,691	0.7	4.5	-8.4	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	98,600	-1.00	31.0	75.2	46,322	448	0.00%	-2,872	1,628	1,244	-212	1,822
삼성전기	179,000	1.42	42.6	59.8	28,445	1,902	0.17%	3,063	-214	-2,849	-2,570	-1,846
기아	88,500	1.03	114.8	59.8	143,355	1,824	0.01%	9,339	-1,988	-7,351	222	-7,351
KT	32,800	0.00	21.2	59.8	86,884	-7,098	0.06%	-13,396	2,206	11,189	1,272	9,917
NAVER	398,000	2.31	271.6	55.5	62,392	5,151	-0.01%	4,104	1,585	-5,783	-4,744	-1,271
하나금융지주	45,000	-1.21	28.0	49.8	160,986	7,156	0.14%	-3,038	3,801	-928	-1,144	-3,140
삼성 SDI	675,000	3.69	151.9	49.7	30,234	1,159	0.07%	64	-117	38	-1,012	-75
카카오	156,000	5.05	582.2	49.0	232,039	2,070	-0.09%	-994	-8,008	8,790	14,680	193
롯데케미칼	272,000	-1.81	23.9	47.2	8,062	-444	-0.48%	-987	-1,581	2,750	2,982	433
LG 화학	822,000	-0.96	92.1	44.1	14,475	-107	-0.17%	-1,301	871	430	444	-274

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터