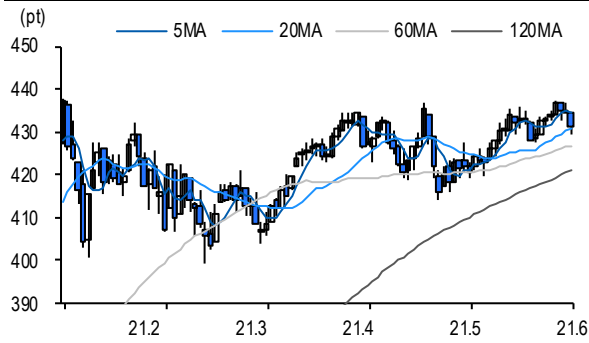


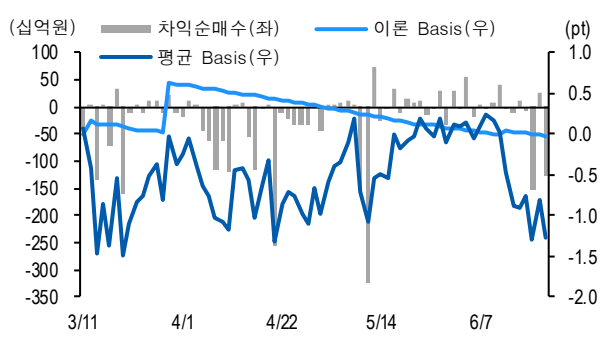
선물옵션시장 지표

2021.6.22

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.46	-0.82	-3.56	11,086.6	-
선물 9월물	430.35	-0.96	-4.15	22,896.7	226,677
선물 12월물	429.80	-0.97	-4.20	23.3	28,481
7월물(mini)	430.10	-0.97	-4.20	2,180.5	56,023
8월물(mini)	430.18	-0.93	-4.04	5.4	418



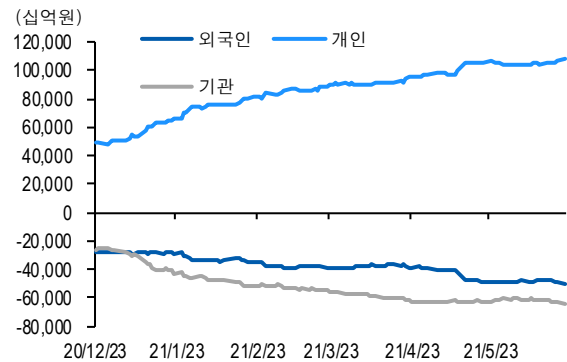
차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.04	-1.27	-1.11	-0.29%	
베이스스(mini)	-0.53	-1.41	-1.36	-0.20%	
제1스프레드(SP)	0.11	-0.45	-0.45	-0.13%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.53	-1.29	-1.29	-0.18%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체	
외국인	-892.8	4.2	-888.6	0.0	-733.1	-675.5	-30.7	2.0	1.1	-27.7	
개인	1,977.2	26.1	2,003.3	0.0	-1.8	44.2	43.2	-3.0	2.2	-90.8	
기관	-1,082.1	-32.9	-1,114.9	-127.4	-123.5	689.2	-27.0	1.6	-3.2	119.5	
금융투자	-616.1	-73.0	-689.1	-47.9	-18.3	849.0	-26.4	2.6	-4.5	106.2	
투신	-32.5	8.3	-24.2	0.0	-0.6	-308.3	-0.6	-0.3	0.0	-39.2	
은행+보험+기타금융	-55.8	30.2	-25.6	0.0	-13.0	21.3	0.0	-0.7	1.4	0.1	
연기금+국가자자체	-233.0	-2.3	-235.3	-79.5	-51.4	127.3	0.0	0.0	0.0	52.4	
기타법인	-2.4	2.6	0.2	0.0	0.8	-57.9	14.5	-0.6	-0.1	-1.0	

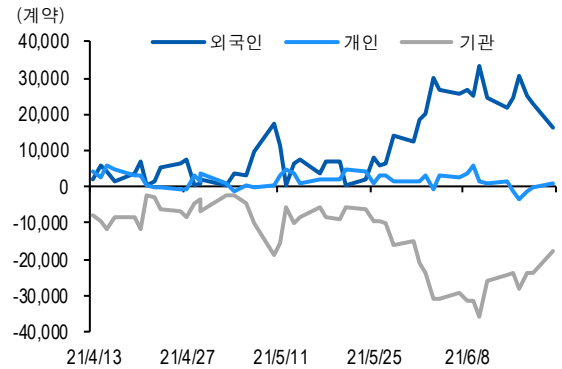
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



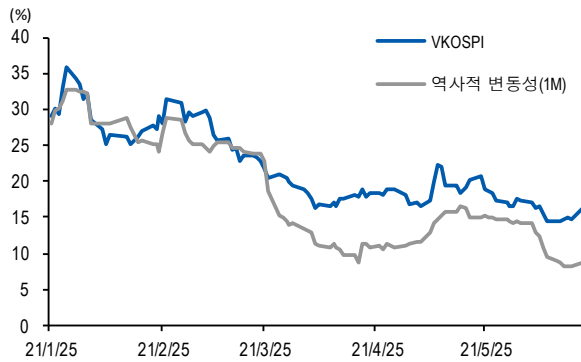
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	509,947	147.8	564,131	13.1%	지수옵션 전체	1,261,595	427.4	1,562,822
Put	751,648	279.6	998,691	15.9%	PCR(금액기준)	1.89	VKOSPI	16.28%(+1.66%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	1.27	-0.80	44,575	15,706	2,484	13.2	Put	437.5(K+1)	9.85	2.85	420	1,429	49	15.6
	440.0(K+2)	1.78	-0.99	63,140	14,041	2,729	13.1		435.0(K+0)	8.14	2.47	3,805	3,959	635	15.4
	437.5(K+1)	2.45	-1.31	45,200	10,631	299	13.2		432.5(K-1)	6.70	2.20	7,051	7,110	1,415	15.4
	435.0(K+0)	3.31	-1.54	24,990	9,508	397	13.2		430.0(K-2)	5.52	1.87	9,128	7,206	883	15.7
	432.5(K-1)	4.37	-1.90	9,629	7,983	1,318	13.4		427.5(K-3)	4.49	1.59	12,843	5,358	169	15.9

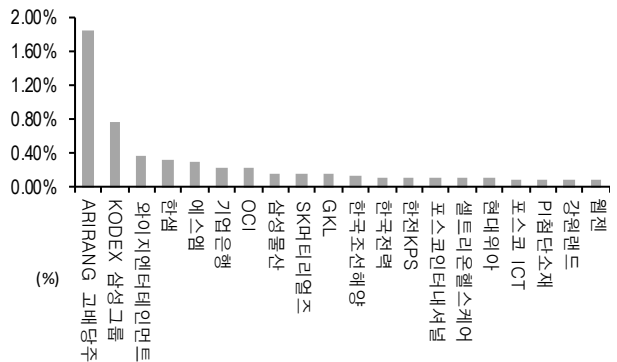
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,875,373	3,770.2	7,143,122	1,501	-119,476	-93,631	217,633	-27.7	-90.8	119.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	823,000	0.12	95.7	81.1	14,460	-15	-0.12%	685	-139	-574	-699	549
NAVER	396,000	-0.50	241.8	75.4	58,834	-3,558	-0.02%	-2,884	-2,363	5,247	3,510	1,619
하나금융지주	43,900	-2.44	41.4	72.8	144,429	-16,557	-0.04%	8,805	-27,049	18,511	15,798	2,873
삼성 SDI	681,000	0.89	165.4	62.7	31,278	1,044	0.06%	-355	-297	715	-140	-447
현대차	233,000	-0.64	115.2	60.1	80,025	-9,791	-0.55%	2,638	-7,760	5,117	6,565	440
기아	87,300	-1.36	108.5	59.9	139,572	-3,783	0.01%	-3,003	-977	4,081	2,740	1,091
S-Oil	100,500	0.80	17.2	56.0	17,561	4,849	-0.14%	1,921	237	-2,158	-4,798	-1,402
삼성전기	174,000	-2.79	35.6	51.2	24,440	-4,005	-0.16%	-2,722	-879	3,586	2,929	2,781
SK 이노베이션	274,500	-0.72	76.9	50.8	25,523	669	-0.36%	2,220	-82	-1,895	2,570	-124
호텔신라	95,400	-3.25	35.8	50.8	45,666	-656	-0.05%	3,410	-4,481	1,070	1,714	-510

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터