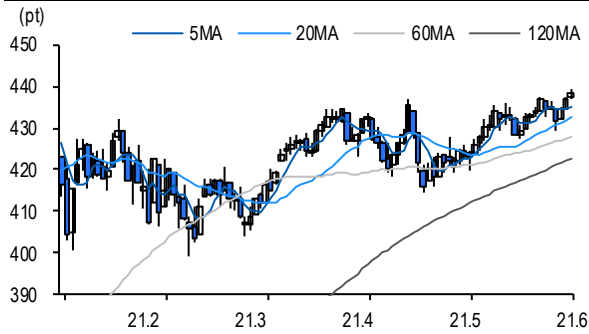


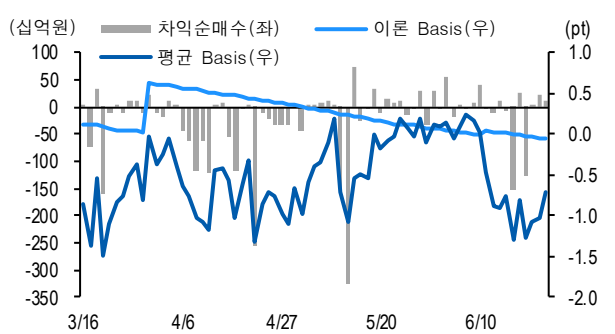
선물옵션시장 지표

2021.6.25

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	438.38	0.38	1.65	14,562.1	-
선물 9월물	437.70	0.42	1.85	16,659.8	230,683
선물 12월물	437.05	0.39	1.70	13.1	28,506
7월물(mini)	437.36	0.40	1.74	1,827.4	68,283
8월물(mini)	437.26	0.40	1.76	3.9	685



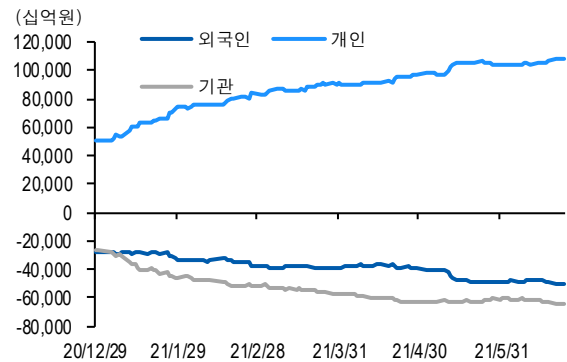
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-0.04	-0.71	-0.68	-0.15%
베이스스(mini)	-0.55	-0.99	-1.02	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.50	-0.50	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.55	-0.95	-0.95	-0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-107.1	4.3	-102.8	0.0	-50.9	548.6	-69.4	0.0	-2.3	13.6
개인	-42.6	66.2	23.6	0.0	6.7	-156.7	27.5	1.4	0.1	-20.0
기관	135.9	-73.8	62.1	13.1	-116.3	-406.8	47.1	-1.6	2.2	8.3
금융투자	341.0	3.5	344.5	2.2	-33.6	-139.5	48.8	-1.6	2.2	-25.3
투신	-38.8	-7.9	-46.7	0.0	-55.2	-231.6	0.0	0.0	-0.1	43.3
은행+보험+기타금융	-81.5	-90.5	-172.0	0.0	-3.5	-10.5	-1.5	0.0	0.0	-7.6
연기금+국가지자체	-39.5	0.1	-39.4	10.9	-9.4	-25.2	-0.2	0.0	0.0	-2.1
기타법인	13.8	3.3	17.1	0.0	1.5	14.9	-5.2	0.2	0.0	-1.8

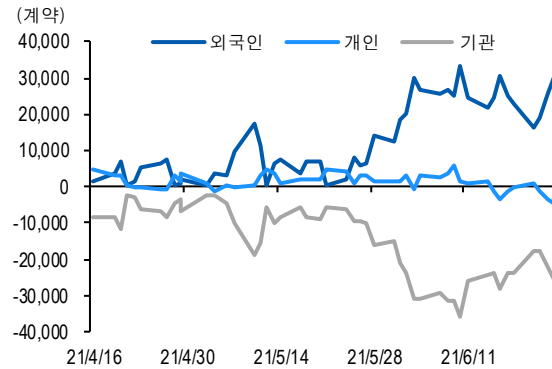
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

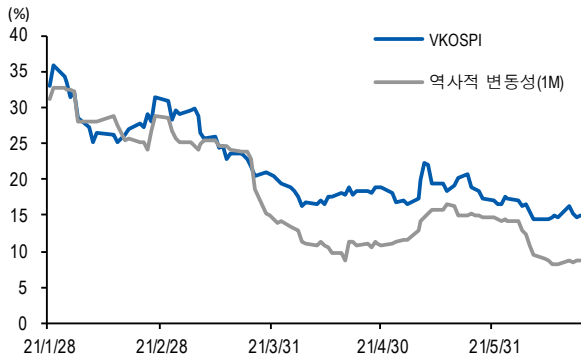
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성	지수옵션 전체	거래량	거래대금	미결제약정
Call	609,047	193.5	600,036	11.9%	PCR(금액기준)	1,088,902	319.9	1,664,933
Put	479,855	126.4	1,064,897	14.1%				

	Call				Put			
	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성
	445.0(K+3)	1.58	0.33	11.8	440.0(K+1)	5.81	-1.22	13.1
	442.5(K+2)	2.30	0.46	11.9	437.5(K+0)	4.49	-1.04	13.2
	440.0(K+1)	3.24	0.59	11.9	435.0(K-1)	3.46	-0.86	13.5
	437.5(K+0)	4.42	0.77	12.0	432.5(K-2)	2.66	-0.70	13.9
	435.0(K-1)	5.88	0.94	12.2	430.0(K-3)	2.04	-0.55	14.3

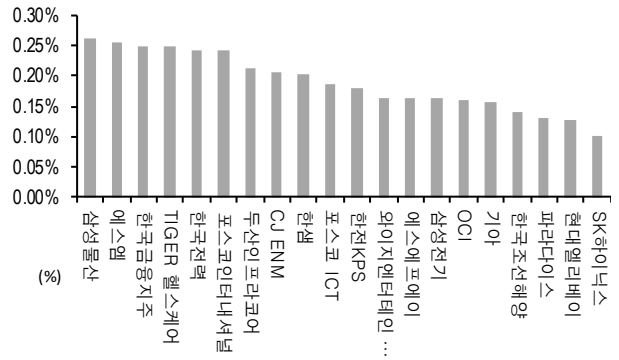
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,552,448	6,139.3	7,394,444	69,883	84,378	9,805	-94,784	13.6	-20.0	8.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	419,500	-1.18	791.3	87.2	69,853	-3,053	0.00%	-2,156	-182	2,914	-988	3,865
SK 텔레콤	325,000	0.00	47.0	78.9	10,858	268	-0.14%	-1,485	1	1,475	664	838
KT	32,250	-0.62	20.3	75.9	93,622	3,502	0.09%	-3,072	1,775	1,293	206	1,147
현대차	242,000	-0.21	265.9	72.9	99,457	9,194	-0.31%	-3,993	8,147	-3,959	-6,112	650
기아	90,900	0.55	269.1	67.3	181,218	25,876	0.16%	-5,051	8,717	-3,665	-6,310	-5,117
카카오	156,000	-8.24	1,853.0	61.9	253,704	16,533	-0.18%	3,991	-43,530	40,804	43,485	-857
삼성전자	80,800	0.87	901.0	60.3	1,304,227	22,519	0.04%	3,826	36,870	-42,444	-37,643	-100
하나금융지주	45,400	1.91	26.7	59.6	142,945	266	-0.02%	8,207	-1,101	-5,980	-4,130	-2,330
LG 화학	829,000	-0.60	88.3	56.4	13,914	-291	-0.10%	-547	1,187	-641	-96	-121
호텔신라	95,800	0.31	31.2	56.0	40,533	-2,057	-0.05%	3,685	-1,694	-2,023	-1,396	-250

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터