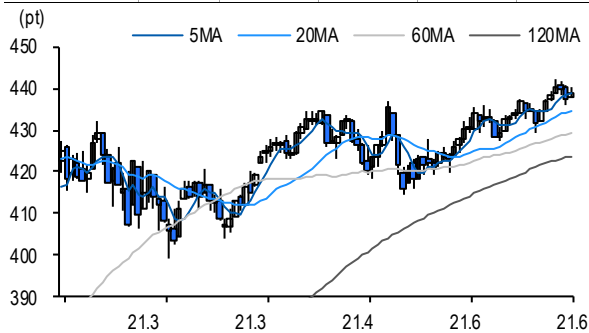


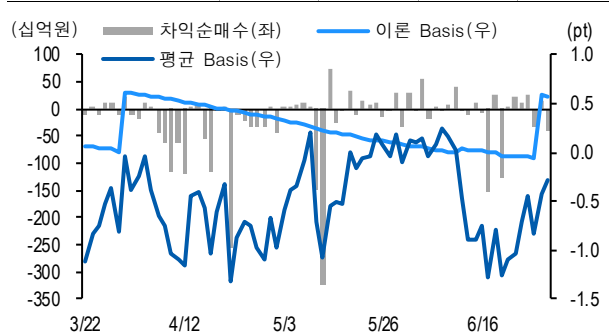
선물옵션시장 지표

2021.7.1

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	438.84	0.30	1.30	9,536.1	-
선물 9월물	438.85	0.41	1.80	14,367.5	233,750
선물 12월물	438.30	0.37	1.60	7.7	28,509
7월물(mini)	438.72	0.40	1.74	1,593.2	64,867
8월물(mini)	438.70	0.41	1.80	5.0	903



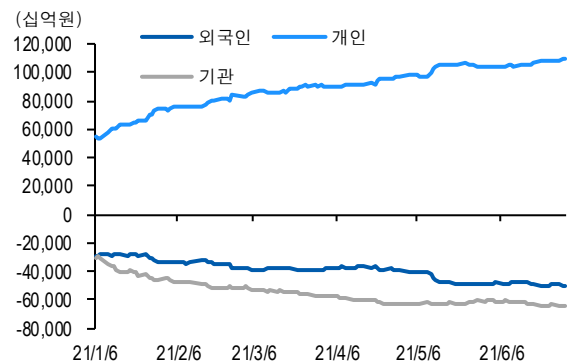
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.58	-0.29	0.01	-0.20%
베이스(mini)	0.07	-0.41	-0.12	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.35	-0.35	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	0.07	-0.12	-0.12	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-12.6	20.9	8.2	-7.9	0.4	362.9	32.0	0.8	-1.3	12.0
개인	31.5	-47.0	-15.4	0.0	-3.4	-255.7	-68.0	0.0	-0.4	94.5
기관	-51.9	28.1	-23.8	-31.2	9.2	-99.8	48.8	-0.9	1.7	-109.3
금융투자	-46.0	70.2	24.2	-2.7	-13.6	-465.2	35.8	-0.8	1.4	-90.1
투신	23.6	1.8	25.4	0.0	9.3	354.2	-0.9	-0.1	0.0	-3.5
은행+보험+기타금융	8.4	-40.2	-31.9	0.0	-2.9	-11.3	13.8	0.0	0.3	-0.2
연기금+국가지자체	32.4	0.6	33.1	-28.5	30.8	22.6	0.0	0.0	0.0	-15.5
기타법인	33.0	-2.0	31.0	0.0	0.3	-7.3	-12.8	0.1	-0.1	2.9

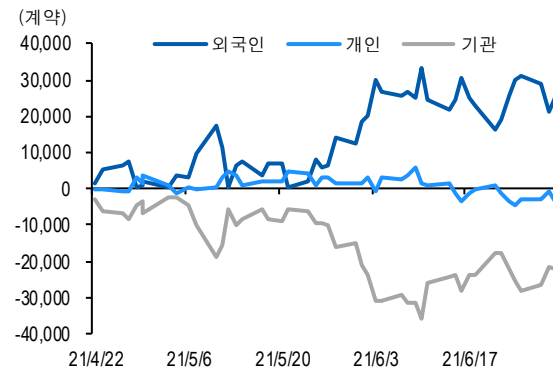
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



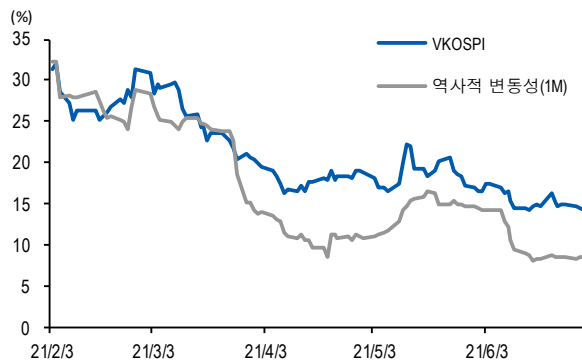
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	610,423	169.6	676,947	11.2%	지수옵션 전체	1,159,451	282.0	1,865,003			
Put	549,028	112.5	1,188,056	13.0%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	14.17%(-0.35%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	445.0(K+3)	0.97	0.09	93,192	22,260	1,120	11.2	Put	440.0(K+1)	3.86	-1.37	12,736	5,558	1,379	11.9
	442.5(K+2)	1.64	0.22	72,219	20,640	-745	11.3		437.5(K+0)	2.68	-1.15	32,334	10,678	2,891	12.2
	440.0(K+1)	2.58	0.38	66,017	18,342	425	11.2		435.0(K-1)	1.83	-0.90	47,950	12,244	2,089	12.6
	437.5(K+0)	3.90	0.60	20,282	12,669	704	11.5		432.5(K-2)	1.24	-0.67	55,054	14,304	2,798	13.1
	435.0(K-1)	5.55	0.84	5,041	11,771	602	11.8		430.0(K-3)	0.82	-0.49	65,762	19,688	522	13.5

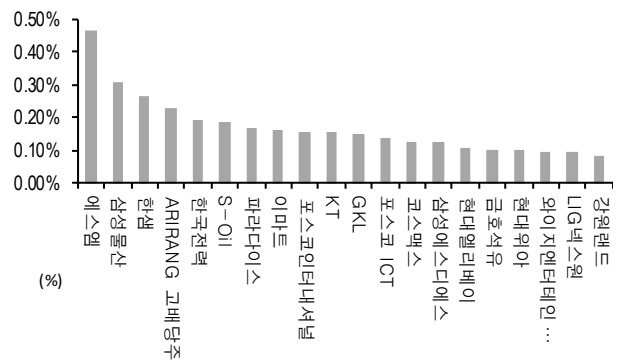
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,468,398	3,780.1	7,426,095	99,853	-45,351	35,427	9,688	12.0	94.5	-109.3			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	418,000	1.58	369.8	93.1	71,368	1,032	0.05%	-3,074	7,405	-4,832	-1,460	-3,710
기아	89,600	0.11	104.9	78.0	159,205	-5,029	0.03%	4,557	-1,570	-2,807	2,106	2,678
호텔신라	97,100	-0.21	19.4	75.5	39,575	-134	0.02%	145	580	-693	-763	70
카카오	163,500	3.15	850.3	72.6	210,411	-42,037	0.00%	-9,418	25,854	-17,199	-19,494	995
삼성 SDI	700,000	1.16	156.4	66.4	34,738	1,904	0.05%	1,240	1,157	-2,398	-2,425	-513
POSCO	348,500	0.29	76.2	66.2	16,522	327	0.00%	700	-195	-501	1,561	-2,000
삼성전자	80,900	0.00	607.4	61.5	1,313,144	-16,012	0.04%	15,271	-18,679	3,588	-10,914	12,100
SK 이노베이션	296,500	4.96	208.5	54.5	30,566	4,179	0.06%	3,546	3,260	-6,770	-5,020	-2,574
LG 전자	163,500	1.87	93.9	51.6	50,958	-4,307	-0.14%	-1,011	2,503	-1,513	-1,448	156
SK 하이닉스	127,500	2.00	281.2	50.7	196,953	9,854	0.05%	5,277	9,135	-14,517	-20,169	2,490

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터