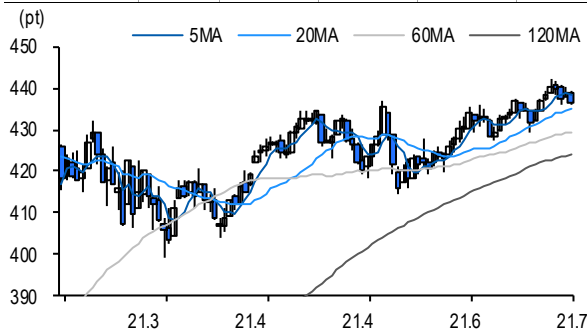


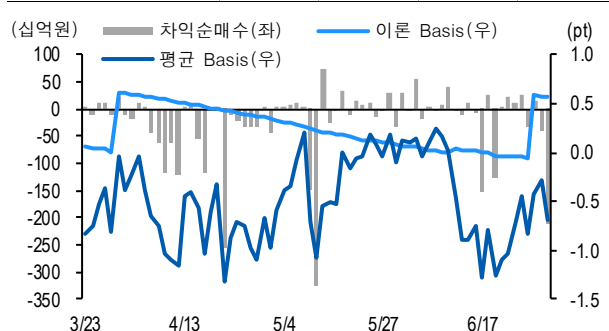
## 선물옵션시장 지표

2021.7.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.34	-0.57	-2.50	10,969.2	-
선물 9월물	435.90	-0.67	-2.95	15,862.5	236,523
선물 12월물	435.40	-0.66	-2.90	22.1	28,535
7월물(mini)	435.90	-0.64	-2.82	1,655.1	65,049
8월물(mini)	435.72	-0.68	-2.98	7.7	1,026



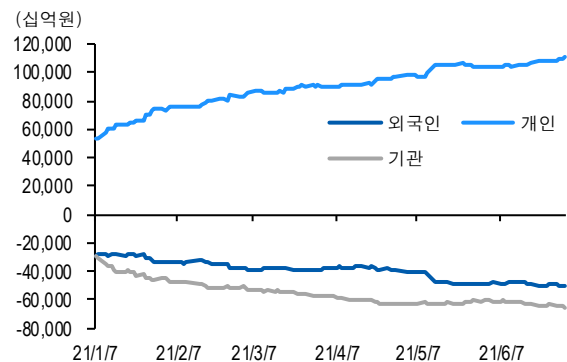
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.58	-0.70	-0.44	-0.29%
베이스(mini)	0.06	-0.59	-0.44	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.42	-0.55	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.06	-0.43	-0.43	-0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-407.3	-26.4	-433.7	-85.8	-233.5	-1,151.3	-27.2	-0.3	0.8	-11.0
개인	1,264.4	26.7	1,291.1	0.0	-1.0	359.3	135.6	-1.4	1.4	-72.4
기관	-871.9	-2.7	-874.7	-125.6	-136.6	795.4	-122.6	2.4	-2.4	84.1
금융투자	-590.9	-30.8	-621.7	-93.6	-37.4	915.9	-121.1	2.3	-2.5	85.2
투신	-51.8	6.3	-45.6	-3.5	-19.2	-155.2	-1.6	0.1	0.0	-40.4
은행+보험+기타금융	8.6	11.0	19.5	0.0	17.5	6.1	0.0	0.0	0.1	0.7
연기금+국가지자체	-206.1	-1.5	-207.6	-28.5	-93.3	28.5	0.1	0.0	0.0	38.7
기타법인	14.9	2.4	17.2	0.0	0.0	-3.4	14.2	-0.6	0.3	-0.7

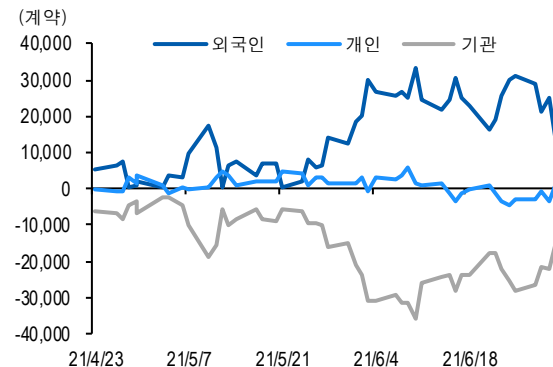
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

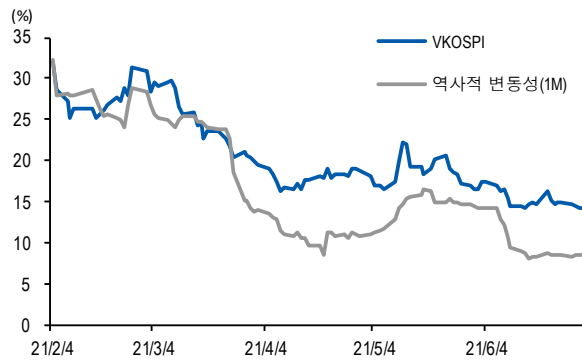
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	677,952	144.2	692,263	10.6%	지수옵션 전체	1,424,003	357.0	1,909,709
Put	746,051	212.7	1,217,446	12.7%	PCR(금액기준)	1.47	VKOSPI	14.33%(+0.16%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	447.5(K+3)	0.17	-0.38	79,993	22,647	3,554	10.7	Put	442.5(K+1)	7.32	1.92	3,718	2,673	1,220	13.3
	445.0(K+2)	0.36	-0.61	106,738	26,625	4,365	10.6		440.0(K+0)	5.39	1.53	10,414	6,173	615	12.7
	442.5(K+1)	0.71	-0.93	94,919	23,910	3,270	10.6		437.5(K-1)	3.79	1.11	27,467	11,846	1,168	12.5
	440.0(K+0)	1.30	-1.28	101,807	21,262	2,920	10.5		435.0(K-2)	2.56	0.73	91,685	14,921	2,677	12.5
	437.5(K-1)	2.18	-1.72	50,627	15,652	2,983	10.4		432.5(K-3)	1.67	0.43	85,834	14,607	303	12.7

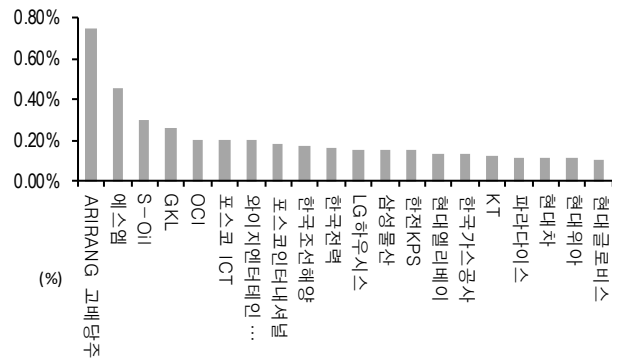
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,598,865	3,830.9	7,287,285	-138,810	-47,478	-49,860	97,765	-11.0	-72.4	84.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	413,000	-1.20	208.7	85.1	65,775	-5,593	0.02%	-430	-1,005	1,484	-959	3,233
삼성전기	177,000	-0.28	34.2	75.7	24,287	194	-0.06%	1,002	-1,647	523	308	215
호텔신라	95,900	-1.24	25.5	75.3	38,522	-1,053	0.03%	-232	-5	137	-979	1,116
현대차	243,500	1.67	169.6	69.1	91,181	2,416	0.12%	1,155	-6,329	5,173	-301	-2,225
기아	90,700	1.23	175.8	66.7	140,903	-18,302	0.00%	823	-7,422	6,593	9,157	4,597
LG 화학	845,000	-0.12	175.0	64.4	16,828	619	0.06%	532	288	-820	-854	-129
카카오	160,500	-1.83	440.0	58.9	207,114	-3,297	-0.02%	10	-5,455	5,505	9,361	2,011
SK 하이닉스	124,000	-2.75	231.8	56.0	174,371	-22,582	-0.13%	508	-11,132	10,524	26,447	2,970
삼성 SDI	724,000	3.43	234.3	54.3	36,716	1,978	0.05%	1,213	-968	-187	-1,604	684
POSCO	345,000	-1.00	37.6	50.8	17,058	536	0.01%	-346	801	-456	99	-555

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터