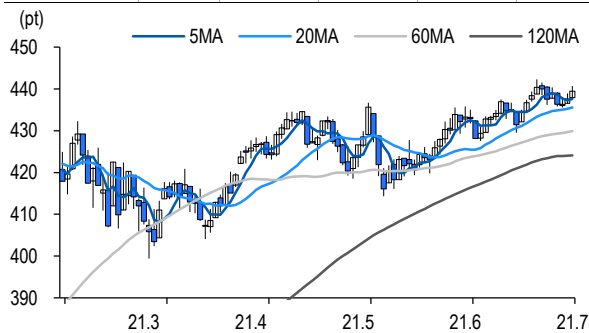


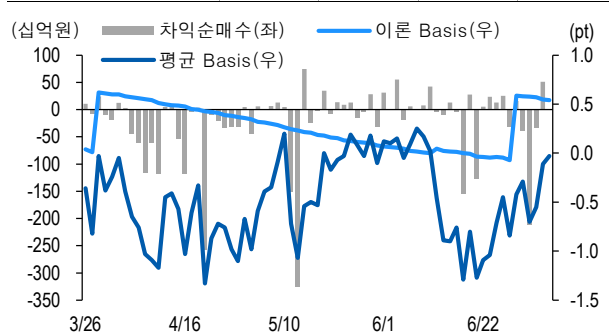
## 선물옵션시장 지표

2021.7.7

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	439.50	0.42	1.84	9,629.8	-
선물 9월물	439.15	0.21	0.90	15,469.2	235,285
선물 12월물	438.70	0.27	1.20	14.6	28,567
7월물(mini)	439.20	0.24	1.06	1,500.3	65,830
8월물(mini)	439.34	0.33	1.46	43.3	9,219



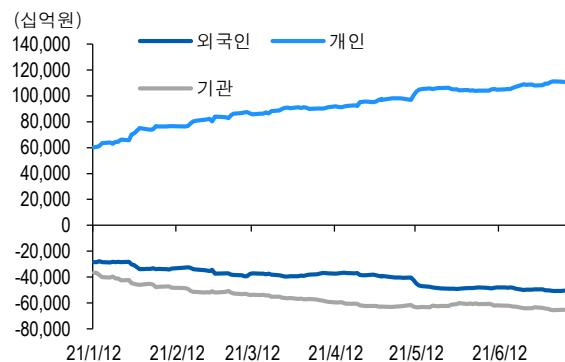
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.54	-0.03	-0.35	-0.13%
베이스(mini)	0.02	-0.07	-0.30	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.40	-0.40	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.26	-0.26	-0.06%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	223.7	16.1	239.9	0.0	45.6	49.9	-2.4	3.1	-0.8	-39.8
개인	-292.6	23.8	-268.8	0.0	-0.5	113.8	5.3	0.5	-3.1	45.6
기관	69.6	-38.7	30.9	0.9	-43.8	-180.4	4.8	-3.1	4.3	-8.8
금융투자	139.9	32.6	172.5	3.1	-3.3	-42.6	2.3	-3.3	4.2	-41.3
투신	25.7	-12.1	13.7	0.0	1.6	-106.5	2.9	-0.1	0.0	25.2
은행+보험+기타금융	-10.8	-47.8	-58.6	0.0	-10.8	-11.5	-0.3	0.2	0.1	1.5
연기금+국가지자체	-96.5	-18.4	-114.8	-2.1	-30.7	-19.8	-0.1	0.0	0.0	5.8
기타법인	-0.7	-1.2	-1.9	0.0	0.3	16.7	-7.7	-0.5	-0.3	2.9

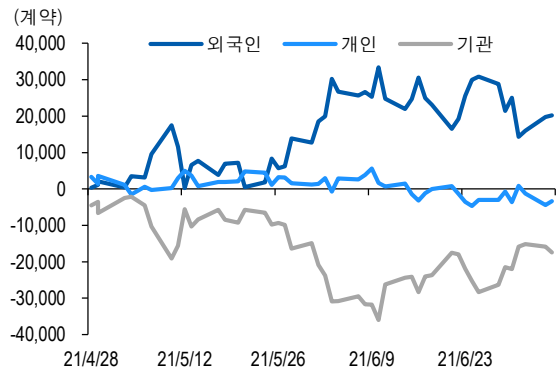
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

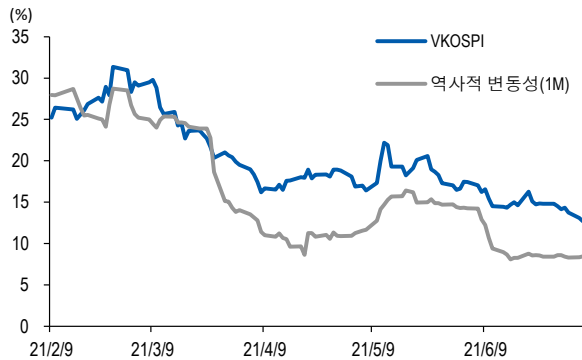
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,086,881	228.0	783,611	10.0%	지수옵션 전체	2,098,865	388.3	2,152,193
Put	1,011,984	160.3	1,368,582	12.4%	PCR(금액기준)	0.70	VKOSPI	12.71%(-0.40%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	445.0(K+3)	0.18	0.01	243,285	37,125	1,790	10.3	Put	440.0(K+1)	2.09	-0.91	99,545	14,579	7,839	11.6
	442.5(K+2)	0.53	0.08	237,113	30,414	627	10.0		437.5(K+0)	0.98	-0.70	164,745	17,210	398	11.4
	440.0(K+1)	1.32	0.23	234,132	23,784	1,106	9.7		435.0(K-1)	0.42	-0.46	194,121	28,280	9,072	11.9
	437.5(K+0)	2.72	0.43	67,882	17,571	-421	9.4		432.5(K-2)	0.19	-0.26	163,464	26,835	3,449	12.8
	435.0(K-1)	4.64	0.66	14,394	13,123	-193	8.1		430.0(K-3)	0.09	-0.15	99,922	37,403	3,860	13.9

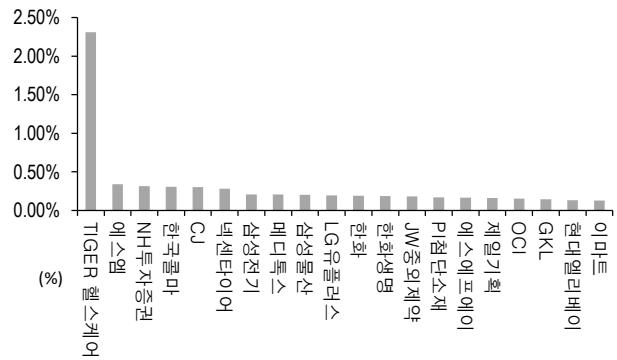
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,398,003	3,837.0	7,482,654	134,140	-44,896	53,616	-10,442	-39.8	45.6	-8.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	81,100	0.87	801.4	81.7	871,194	-232,035	0.05%	326	49,769	-52,404	-17,309	-38,527
호텔신라	97,100	1.46	30.5	77.1	33,392	-1,761	-0.05%	1,412	-1,782	175	-379	554
하나금융지주	45,050	0.22	14.3	72.1	95,541	-5,570	-0.14%	-1,977	-58	1,825	4,356	219
삼성 SDI	748,000	3.31	210.2	70.1	26,306	-2,551	0.07%	112	-173	15	-1,719	274
NAVER	409,500	-0.12	96.0	68.4	27,741	-1,674	0.02%	455	-357	-100	-103	353
SK 하이닉스	125,000	1.21	167.3	64.8	139,595	-9,726	-0.27%	2,578	-4,711	2,130	1,061	1,200
LG 화학	873,000	0.23	85.5	63.1	11,609	-4,946	-0.02%	-2,149	72	2,076	-104	2,180
카카오	158,000	0.64	179.3	56.1	185,973	-3,807	-0.03%	-1,157	-1,478	2,627	976	2,050
기아	88,700	-0.34	67.8	52.8	112,386	-10,875	0.04%	1,270	717	-1,987	-812	3,354
삼성전기	185,500	-1.59	67.7	52.8	31,772	-3,522	0.21%	-4,199	2,422	1,775	-3,118	2,463

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터