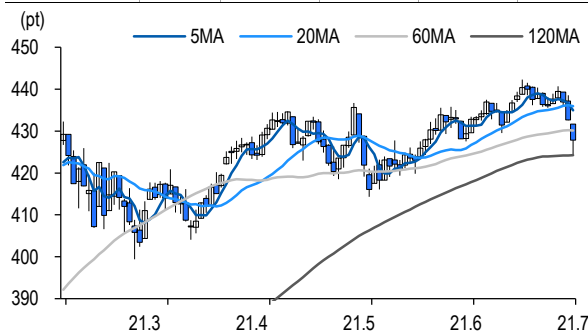


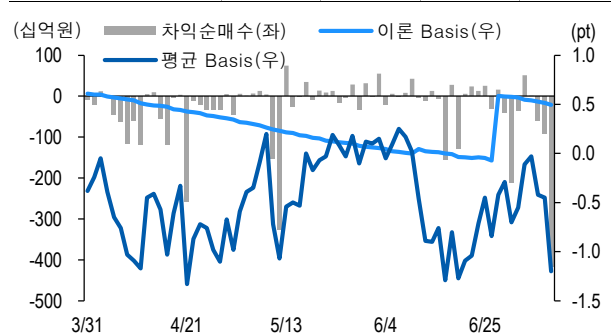
선물옵션시장 지표

2021.7.12

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	427.84	-1.11	-4.79	11,943.1	-
선물 9월물	426.25	-1.07	-4.60	28,984.4	247,081
선물 12월물	425.70	-1.16	-5.00	40.7	28,605
8월물(mini)	426.50	-0.99	-4.28	2,665.0	35,346
9월물(mini)	426.10	-1.10	-4.96	14.6	2,679



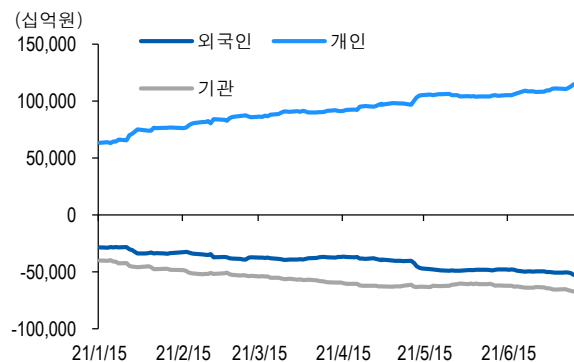
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.49	-1.20	-1.59	-0.40%
베이스(mini)	0.27	-0.98	-1.34	-0.29%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.48	-0.55	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.27	-1.42	-1.42	-0.40%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,333.7	9.4	-1,324.3	-251.1	-683.4	-307.1	-109.8	-1.2	1.3	38.8
개인	1,801.0	-66.2	1,734.8	0.0	-3.7	-498.4	25.4	-3.6	1.9	87.3
기관	-508.4	78.0	-430.3	-164.7	-83.7	860.3	71.7	5.8	-3.2	-127.2
금융투자	-432.3	-92.5	-524.8	-150.2	-31.4	939.0	71.6	6.3	-2.5	-19.8
투신	-4.8	98.7	93.9	-9.2	5.5	12.2	-0.1	-0.6	-0.9	-68.1
은행+보험+기타금융	0.0	58.2	58.2	-1.1	-1.3	-105.3	0.1	0.1	0.1	5.2
연기금+국가지자체	-26.6	6.1	-20.5	-4.3	-42.2	14.4	0.0	0.0	0.0	-44.6
기타법인	41.0	-21.2	19.8	0.0	-0.7	-54.8	12.7	-1.0	0.0	1.1

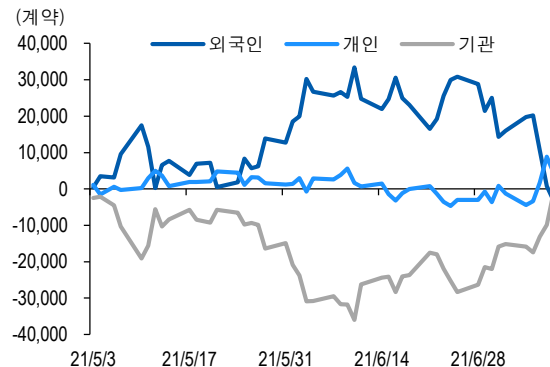
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	626,984	205.5	517,143	11.8%	지수옵션 전체	1,545,592	582.0	1,424,378
Put	918,608	376.5	907,235	15.3%	PCR(금액기준)	1.83	VKOSPI	15.12%(+0.93%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	2.11	-0.92	52,601	10,638	5,180	11.9	Put	435.0(K+1)	11.95	2.95	798	3,376	22	15.1
	437.5(K+2)	2.73	-1.16	31,698	5,860	2,638	11.9		432.5(K+0)	10.45	2.77	1,440	1,677	232	15.2
	435.0(K+1)	3.47	-1.39	19,923	5,501	2,075	11.9		430.0(K-1)	9.00	2.50	4,120	4,697	408	15.2
	432.5(K+0)	4.37	-1.67	12,698	2,957	1,631	11.9		427.5(K-2)	7.74	2.22	4,784	1,924	332	15.2
	430.0(K-1)	5.46	-1.93	7,499	2,846	1,637	12.0		425.0(K-3)	6.62	1.92	11,042	6,903	1,513	15.4

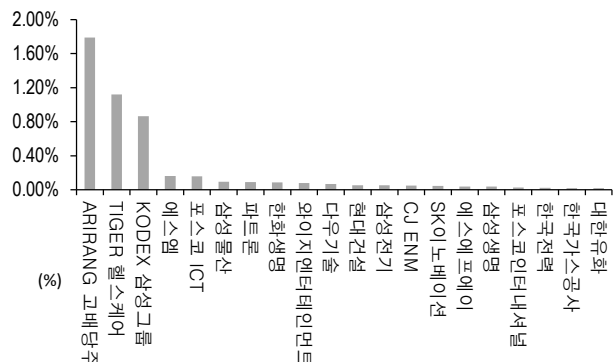
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,579,823	4,077.0	5,831,480	436,296	36,508	151,659	-194,710	38.8	87.3	-127.2	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	736,000	0.55	232.0	85.3	34,419	-1,469	-0.09%	520	-418	-116	1,964	1,059
호텔신라	92,500	-0.43	41.7	83.5	20,941	3,346	-0.03%	1,983	-1,642	-351	1,945	-2,473
삼성전기	183,000	0.27	82.2	79.9	38,009	3,015	0.05%	2,573	5,131	-7,706	-4,268	-2,941
NAVER	416,000	-1.89	351.9	78.2	85,200	681	-0.01%	185	140	-307	1,474	-661
LG 이노텍	228,000	-0.44	27.8	76.5	10,159	1,229	-0.03%	1,523	-20	-1,543	-918	-925
GS 건설	42,050	-0.83	22.2	71.7	42,684	3,537	0.00%	-1,563	4,751	-3,188	-988	-1,551
카카오	160,000	-1.23	408.7	67.7	179,625	5,316	-0.26%	2,209	-9,933	7,734	14,660	-3,260
SK 이노베이션	271,500	1.12	117.3	63.2	29,793	5,813	0.04%	4,489	580	-5,091	-2,165	-5,240
KT	32,300	-1.07	28.2	59.9	88,730	9,599	0.00%	5,107	8,672	-13,787	-7,028	-6,759
기아	86,200	-1.26	102.9	54.1	106,839	5,767	-0.01%	-1,175	2,883	-1,680	598	-2,281

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터