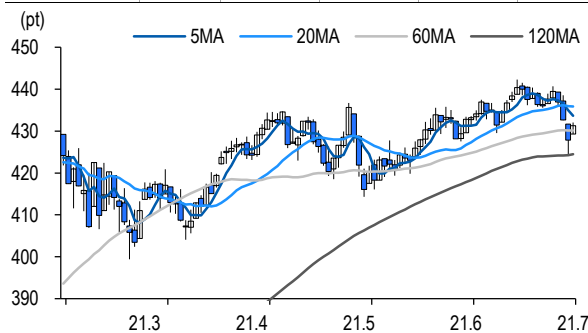


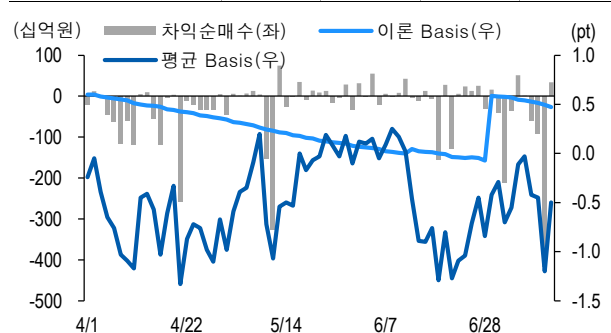
선물옵션시장 지표

2021.7.13

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.28	0.80	3.44	7,111.9	-
선물 9월물	431.50	1.23	5.25	18,159.8	243,909
선물 12월물	430.80	1.20	5.10	23.7	28,964
8월물(mini)	431.60	1.20	5.10	1,763.1	37,503
9월물(mini)	431.20	1.16	5.10	3.2	3,980



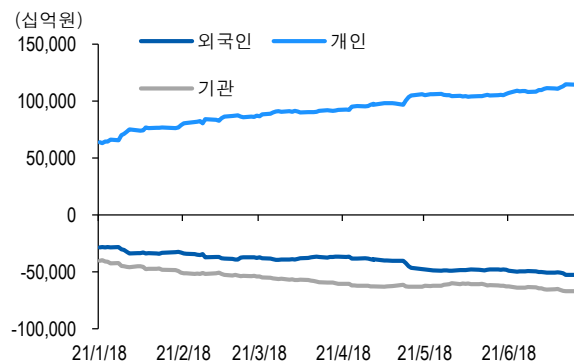
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.47	-0.50	0.22	-0.23%
베이스(mini)	0.25	-0.47	0.32	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.59	-0.60	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	0.25	0.25	0.00%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	38.2	-32.6	5.6	0.0	72.9	826.6	-44.9	3.7	1.4	-24.8
개인	-228.9	16.0	-212.9	0.0	8.2	-551.4	-65.8	-2.5	-1.2	1.7
기관	218.7	17.8	236.6	34.1	16.9	-272.4	114.7	0.2	0.6	23.4
금융투자	137.5	33.3	170.8	-13.4	-1.1	-684.1	114.7	0.3	1.4	46.2
투신	30.2	-1.5	28.8	0.0	5.2	446.4	0.0	-0.4	-0.1	40.9
은행+보험+기타금융	-9.5	-16.4	-25.9	0.0	-3.4	7.5	0.0	0.3	-0.7	3.9
연기금+국가지자체	49.7	-9.4	40.3	47.5	17.8	-42.1	0.0	0.0	0.0	-67.6
기타법인	-28.0	-1.3	-29.3	0.0	-0.4	-2.8	-4.1	-1.4	-0.9	-0.3

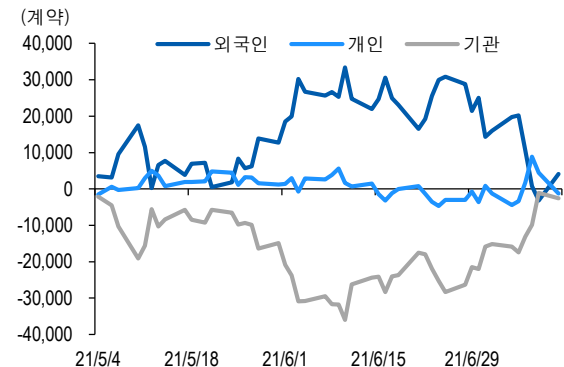
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	321,750		130.5		534,649		12.1%		지수옵션 전체		771,796		265.5		1,497,339	
Put	450,046		135.1		962,690		13.4%		PCR(금액기준)		1.04		VKOSPI		13.62%(−1.50%p)	

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	4.58	1.11	10,325	6,952	1,451	12.0	Put	430.0(K+1)	5.59	−3.41	7,319	4,944	247	12.4
	432.5(K+2)	5.79	1.42	4,891	3,299	342	12.3		427.5(K+0)	4.67	−3.07	2,910	2,169	245	12.8
	430.0(K+1)	7.16	1.70	6,652	3,304	458	12.5		425.0(K−1)	3.84	−2.78	6,920	7,824	921	13.1
	427.5(K+0)	8.70	2.02	2,570	1,334	62	12.8		422.5(K−2)	3.17	−2.48	8,728	3,418	136	13.4
	425.0(K−1)	10.40	2.36	1,464	1,803	114	13.1		420.0(K−3)	2.67	−2.15	19,152	10,733	2,544	13.9

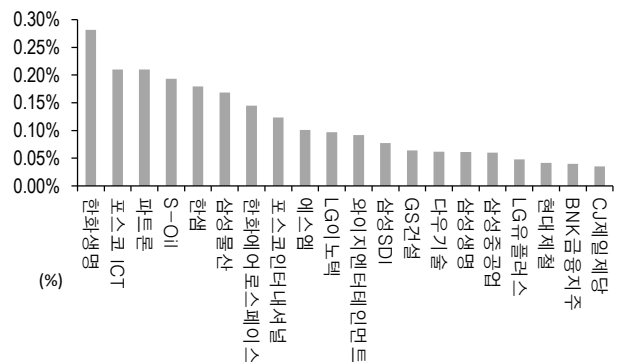
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,978,453	2,823.7	5,870,806	39,326	-4,805	-18,951	28,793	-24.8	1.7	23.4		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균피리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	419,000	0.72	218.3	110.5	84,310	-890	-0.04%	-53	-336	389	1,599	104
삼성 SDI	731,000	-0.68	176.3	106.5	37,064	2,645	0.08%	-1,326	1,607	-267	-116	-2,997
LG 이노텍	228,500	0.22	18.5	85.3	12,319	2,160	0.10%	-1,845	2,811	-964	-466	-543
카카오	163,000	1.88	430.5	82.9	182,273	2,648	-0.09%	2,981	3,206	-6,187	709	-7,180
호텔신라	93,500	1.08	15.8	82.6	22,562	1,621	0.01%	194	-862	669	1,460	-791
기아	87,900	1.97	108.0	80.4	108,311	1,472	0.01%	2,677	-2,193	-489	4,900	-7,362
KT	32,650	1.08	15.6	80.2	90,629	1,899	-0.01%	1,217	357	-1,566	2,611	-4,177
하나금융지주	43,150	1.89	43.2	76.2	148,255	2,898	0.00%	3,553	-525	-2,716	-3,484	-3,486
삼성전기	187,500	2.46	67.6	63.6	40,655	2,646	0.03%	115	2,326	-2,439	-39	-2,658
삼성전자	79,700	0.38	472.5	60.9	1,109,211	-11,308	-0.15%	-13,241	-4,956	18,128	15,142	2,700

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터