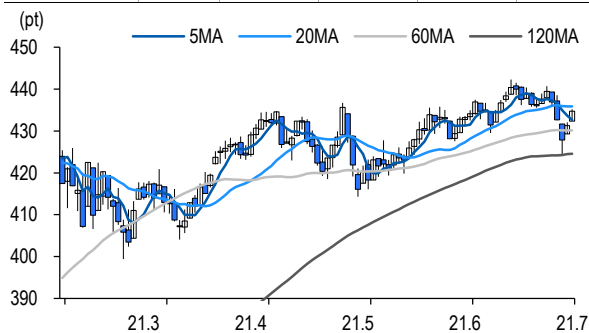


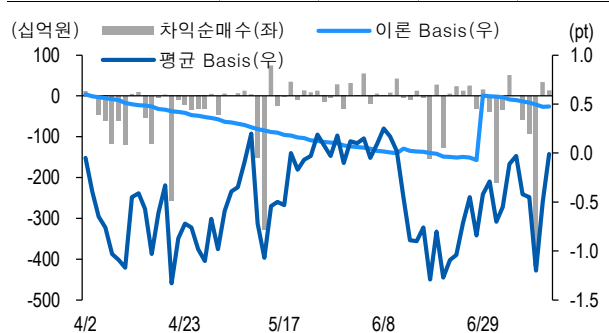
## 선물옵션시장 지표

2021.7.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.71	0.80	3.43	7,999.0	-
선물 9월물	434.60	0.72	3.10	13,838.3	239,272
선물 12월물	434.05	0.75	3.25	17.3	28,976
8월물(mini)	434.54	0.68	2.94	1,443.9	38,310
9월물(mini)	434.58	0.71	3.38	3.4	4,515



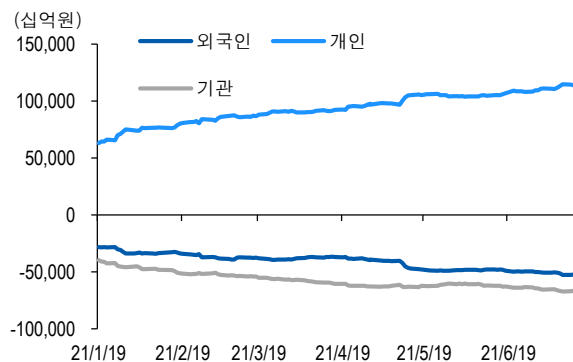
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.48	-0.01	-0.11	-0.11%
베이스(mini)	0.25	-0.07	-0.17	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.62	-0.60	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	-0.13	-0.13	-0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	264.4	8.9	273.4	0.4	314.0	721.2	44.3	-3.9	1.9	73.3
개인	-562.4	6.3	-556.1	0.0	-25.3	-217.8	-73.7	1.9	-1.8	7.2
기관	306.7	-12.1	294.7	13.1	-67.9	-516.5	42.7	1.7	0.4	-82.5
금융투자	263.3	173.3	436.6	2.3	-40.9	-742.4	42.8	1.7	0.9	-89.6
투신	32.2	-6.6	25.6	0.0	27.2	230.7	-0.1	-0.1	0.1	55.9
은행+보험+기타금융	-4.1	-205.2	-209.4	0.0	-1.8	8.3	0.0	0.0	-0.5	0.2
연기금+국가지자체	44.2	-20.9	23.3	10.8	-19.1	-13.1	0.0	0.0	0.0	-49.0
기타법인	-8.7	-3.1	-11.9	0.0	-5.8	13.0	-13.3	0.3	-0.6	2.0

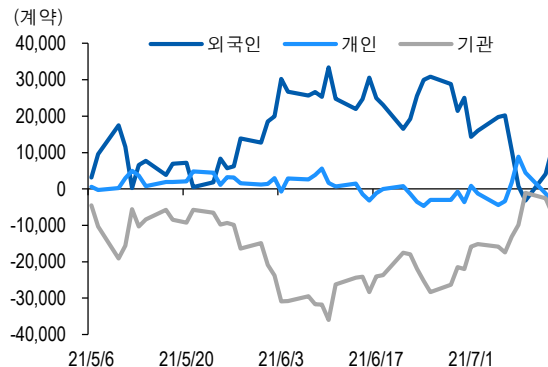
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	319,581	119.9	539,090	10.6%	지수옵션 전체	685,124	224.5	1,550,565
Put	365,543	104.6	1,011,475	12.5%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	12.55%(-1.07%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	3.23	0.50	25,034	11,625	-472	10.6	Put	435.0(K+1)	5.90	-2.09	4,249	4,247	1,041	11.6
	437.5(K+2)	4.24	0.70	7,173	5,697	-23	10.7		432.5(K+0)	4.82	-1.87	3,584	2,149	365	11.8
	435.0(K+1)	5.51	0.93	6,300	7,590	638	10.9		430.0(K-1)	3.94	-1.65	6,434	5,844	900	12.1
	432.5(K+0)	6.90	1.11	4,785	3,185	-114	11.1		427.5(K-2)	3.18	-1.49	7,897	2,817	648	12.4
	430.0(K-1)	8.49	1.33	2,376	3,453	149	11.3		425.0(K-3)	2.59	-1.25	16,467	9,270	1,446	12.7

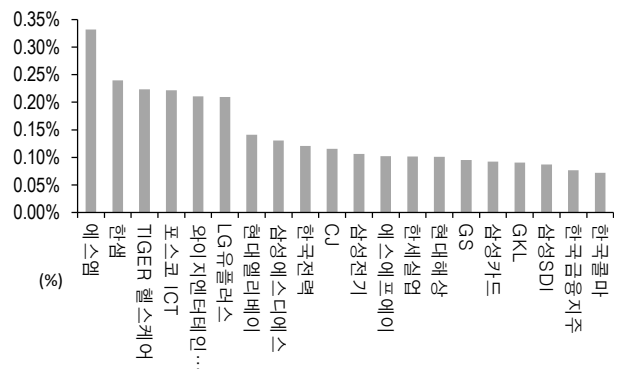
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,953,389	3,104.5	5,961,172	90,366	65,361	3,417	-70,993	73.3	7.2	-82.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	751,000	2.74	191.6	81.6	41,408	4,344	0.09%	982	-884	-98	-3,290	-1,453
NAVER	441,000	5.25	467.8	72.2	93,698	9,388	0.06%	1,786	1,584	-3,436	-5,558	-2,030
카카오	161,000	-1.23	437.9	71.3	181,596	-677	0.06%	763	5,631	-6,466	-6,405	770
LG 전자	164,000	3.47	113.6	64.1	56,950	13,935	0.06%	4,349	11,452	-15,967	-10,345	-5,920
KT	33,150	1.53	21.6	63.3	97,499	6,870	0.04%	1,967	-4,516	2,569	948	-4,948
호텔신라	95,300	1.93	24.2	62.8	25,112	2,550	-0.01%	1,918	-815	-1,103	940	-2,150
기아	88,300	0.46	68.2	62.0	108,805	494	0.02%	-385	2,038	-1,653	-229	-1,377
삼성전자	79,900	0.25	478.1	61.4	1,068,811	-40,400	-0.01%	31,864	-41,060	8,855	18,557	-9,600
삼성전기	186,500	-0.53	39.3	60.1	39,840	-815	0.11%	-3,404	2,736	665	358	330
하나금융지주	43,700	1.27	21.9	59.7	147,815	-440	-0.01%	-252	-391	458	-859	1,208

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터