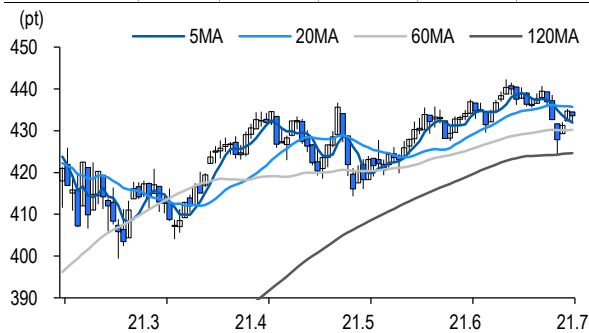


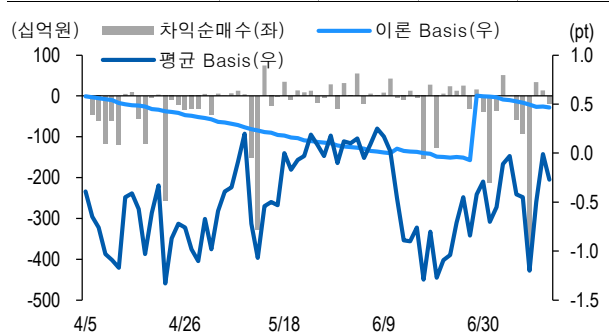
## 선물옵션시장 지표

2021.7.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	433.57	-0.26	-1.14	8,362.9	-
선물 9월물	433.65	-0.22	-0.95	18,147.7	240,627
선물 12월물	432.85	-0.28	-1.20	35.6	28,925
8월물(mini)	433.72	-0.19	-0.82	1,648.9	37,150
9월물(mini)	433.44	-0.27	-1.14	2.7	4,550



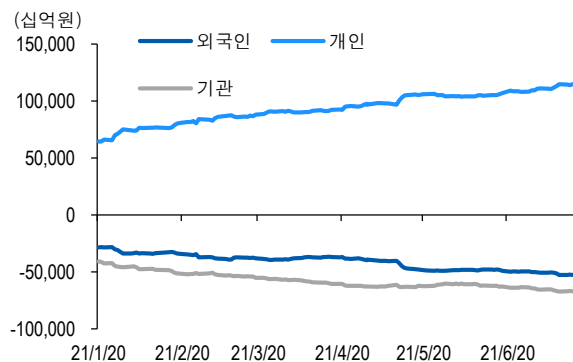
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.47	-0.27	0.08	-0.17%
베이스(mini)	0.24	-0.23	0.15	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.59	-0.60	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.24	0.11	0.11	-0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-272.6	-9.2	-281.8	-6.5	-98.7	-253.4	-26.6	4.0	0.4	-23.1
개인	606.1	75.5	681.6	0.0	-10.0	201.9	38.1	-1.0	-1.0	67.3
기관	-316.4	-63.1	-379.5	-12.6	-40.4	75.7	-14.9	-1.3	1.1	-45.1
금융투자	-197.3	80.4	-116.9	-1.8	-13.8	251.3	-15.0	-1.1	1.2	-77.5
투신	-11.4	-14.9	-26.3	0.0	-2.6	-221.6	0.0	-0.2	0.0	23.8
은행+보험+기타금융	-0.9	-140.3	-141.3	0.0	-1.2	32.6	0.1	0.0	0.0	-1.0
연기금+국가지자체	-52.0	0.9	-51.1	-10.8	-14.7	13.4	-0.1	0.0	0.0	9.7
기타법인	-17.0	-3.3	-20.3	0.0	-2.9	-24.2	3.5	-1.7	-0.5	0.9

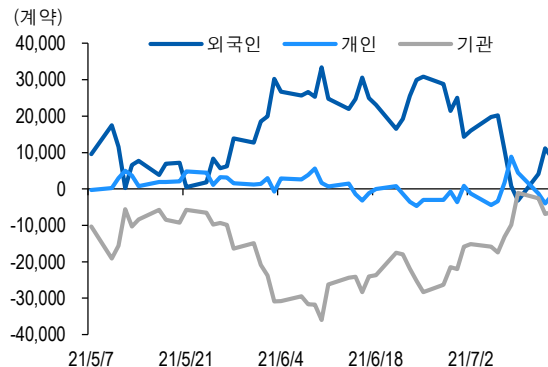
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

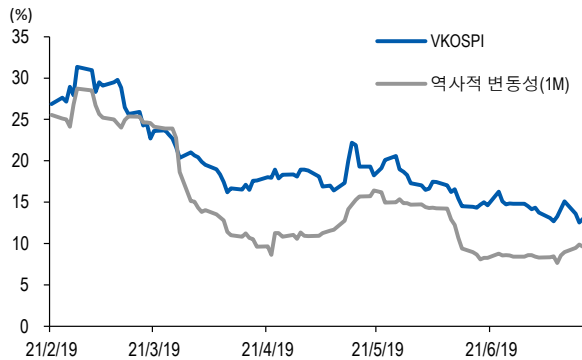
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	346,155	115.0	549,867	10.8%	지수옵션 전체	734,924	252.2	1,581,884
Put	388,769	137.2	1,032,017	12.3%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	12.97%(+0.42%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	2.14	-0.26	43,027	9,490	603	10.8	Put	437.5(K+1)	7.64	0.46	1,415	1,546	78	11.3
	440.0(K+2)	2.92	-0.31	32,841	12,113	488	10.9		435.0(K+0)	6.34	0.44	2,640	4,214	-33	11.5
	437.5(K+1)	3.86	-0.38	14,504	6,142	445	11.1		432.5(K-1)	5.20	0.38	4,993	2,879	730	11.8
	435.0(K+0)	5.02	-0.49	8,701	8,010	420	11.3		430.0(K-2)	4.26	0.32	6,977	6,125	281	12.1
	432.5(K-1)	6.40	-0.50	4,426	3,585	400	11.5		427.5(K-3)	3.45	0.27	10,948	3,289	472	12.4

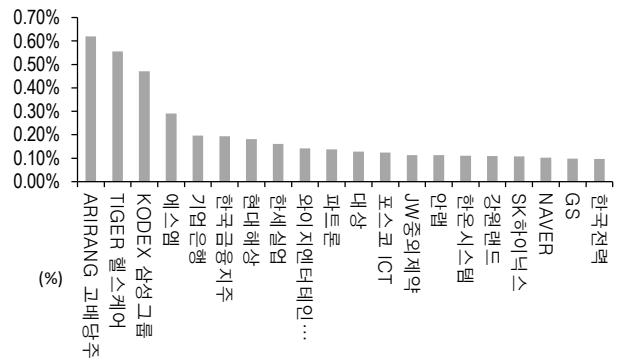
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	2,524,855	2,701.9	6,066,155	104,983	-14,598	53,707	-40,253	-23.1	67.3	-45.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	747,000	-0.53	134.5	87.3	42,112	704	0.04%	297	889	-1,239	-1,770	595
NAVER	444,000	0.68	308.7	75.2	94,226	528	0.10%	-3,377	-480	3,857	-411	1,456
카카오	162,500	0.93	382.3	72.8	186,505	4,909	-0.03%	2,517	4,537	-7,057	-5,723	-1,765
기아	87,700	-0.68	83.5	62.4	113,024	4,219	0.02%	-1,822	982	840	-1,201	-989
KT	33,000	-0.45	14.0	60.0	99,274	1,775	0.06%	-2,365	1,905	253	-1,911	2,164
SK 하이닉스	123,000	-0.40	178.9	59.9	145,282	1,347	0.11%	-1,874	1,971	-97	-7,789	-150
SK 이노베이션	271,000	-0.73	64.5	56.9	30,734	1,711	-0.06%	-2,812	2,433	428	-2,525	1,751
호텔신라	93,700	-1.68	16.5	56.3	24,004	-1,108	0.01%	-1,762	1,155	607	-7	645
SK 텔레콤	321,000	-1.08	28.3	55.9	9,965	1,634	-0.19%	-1,508	172	1,336	1,267	-160
삼성전기	183,500	-1.61	32.9	54.9	35,382	-4,458	0.08%	-539	-2,831	3,366	2,559	1,895

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터