

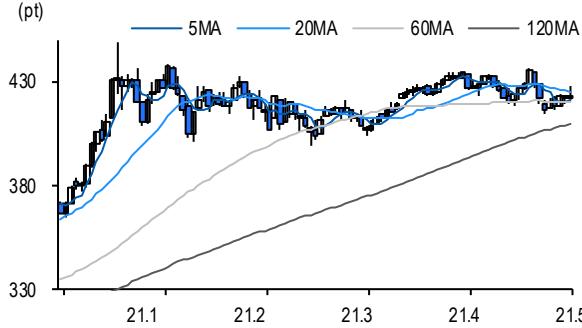


선물옵션시장 지표

2021.5.24

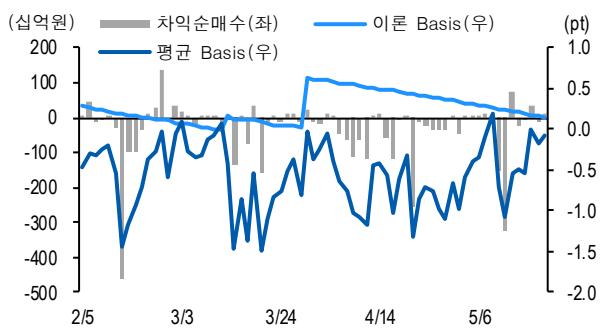
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	422.08	0.09	0.40	10,833.9	-
선물 6월물	421.60	0.05	0.20	31,414.3	234,921
선물 9월물	421.15	-0.01	-0.05	53.2	7,124
6월물(mini)	421.66	0.06	0.12	2,336.8	27,387
7월물(mini)	421.30	0.10	0.40	4.7	476



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.15	-0.07	-0.48	-0.05%
베이시스(mini)	0.15	-0.08	-0.42	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.50	-0.50	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.15	-0.51	-0.51	-0.16%



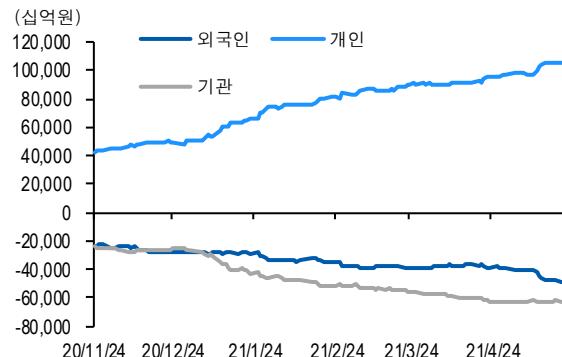
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-135.2	18.3	-116.9	19.7	-118.2	-664.6	-37.7	3.2	-29.8	-18.0
개인	57.7	-9.3	48.5	0.0	4.5	253.5	34.7	0.2	31.3	48.3
기관	58.7	-8.2	50.5	-6.1	6.1	367.1	2.5	-3.6	-1.4	-33.2
금융투자	110.7	-19.3	91.4	0.0	4.3	106.1	2.1	-2.8	-1.4	-53.6
투신	-1.4	12.3	10.9	0.0	1.6	173.4	0.1	0.0	0.0	28.5
은행+보험+기타금융	-11.4	12.4	0.9	0.0	1.3	78.4	0.3	-0.7	0.0	-0.9
연기금+국가지자체	-22.3	-9.5	-31.9	-6.1	-8.3	9.2	0.0	0.0	0.0	-7.2
기타법인	18.8	-0.8	18.0	0.0	0.1	44.1	0.5	0.2	-0.1	2.8

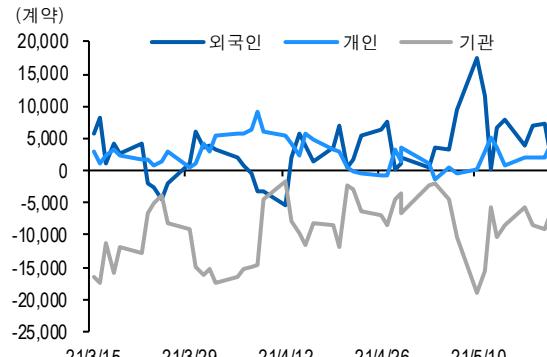
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



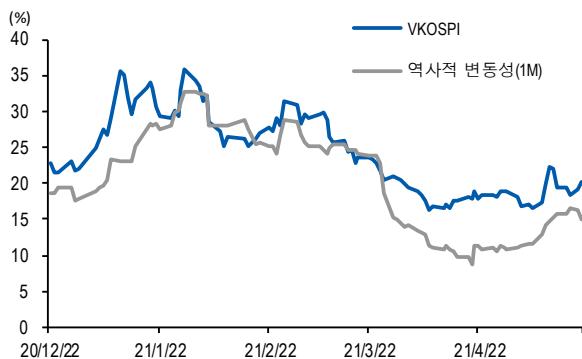
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	840,916	340.1	644,407	16.8%	지수옵션 전체	1,964,617	742.4	1,947,757
Put	1,123,701	402.3	1,303,350	19.8%	PCR(금액기준)	1.18	VKOSPI	20.09% (+0.97%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	430.0(K+3)	3.60	0.31	24,797	13,311	-341	16.6	Put
	427.5(K+2)	4.54	0.36	11,737	7,081	927	16.9	
	425.0(K+1)	5.62	0.38	12,182	10,187	1,062	17.1	
	422.5(K+0)	6.90	0.45	8,124	4,855	412	17.4	
	420.0(K-1)	8.26	0.44	6,300	10,903	343	17.6	

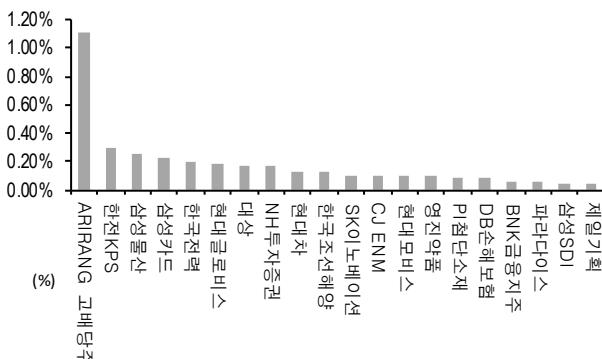
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,684,255	4,245.0	6,090,775	69,646	-84,913	42,313	37,854	-18.0	48.3	-33.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 텔레콤	309,000	0.98	107.1	88.6	10,696	-546	0.02%	-803	-206	1,004
삼성전자	80,000	0.25	1,334.5	79.5	1,332,447	35,480	0.00%	10,310	-10,735	791
롯데케미칼	284,000	-1.56	26.6	76.3	9,721	219	-0.10%	-1,449	509	819
현대차	228,500	1.78	223.1	73.2	114,816	9,145	0.13%	1,103	6,755	-7,752
하나금융지주	44,900	-2.50	51.8	70.2	175,095	587	0.03%	-654	2,028	-2,196
SK 하이닉스	123,000	0.82	339.7	68.6	238,751	2,149	-0.13%	-5,337	-503	5,357
S-Oil	94,300	-2.48	43.3	67.4	16,396	-1,574	0.03%	-224	8,124	-7,898
엔씨소프트	851,000	3.78	72.4	65.4	3,051	166	-0.03%	292	-815	498
POSCO	359,000	-1.37	144.8	64.6	14,755	589	-0.07%	2,658	417	-3,109
호텔신라	90,900	-2.68	59.2	63.8	51,642	-4,372	-0.03%	-4,007	-396	5,605

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표