

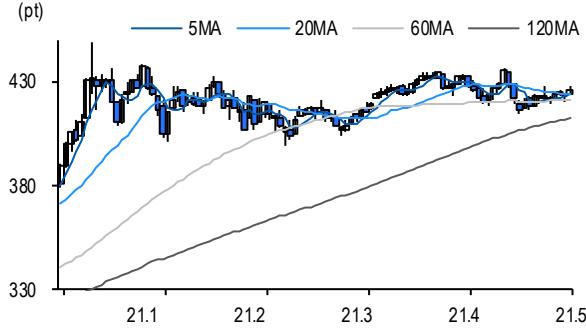


선물옵션시장 지표

2021.5.31

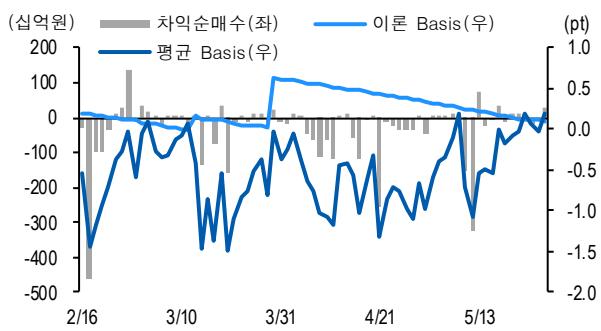
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	425.95	0.70	2.95	9,787.9	-
선물 6월물	426.35	0.89	3.75	21,602.5	247,731
선물 9월물	425.75	0.89	3.75	73.6	8,975
6월물(mini)	426.32	0.88	3.72	1,611.4	37,576
7월물(mini)	425.14	0.72	3.04	4.9	734



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.10	0.18	0.40	0.02%
베이시스(mini)	0.10	0.18	0.37	0.02%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.56	-0.55	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.36	0.36	0.06%



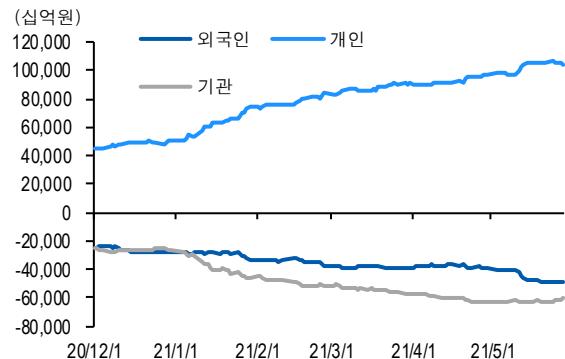
투자주체별 매매 동향

(십억원)

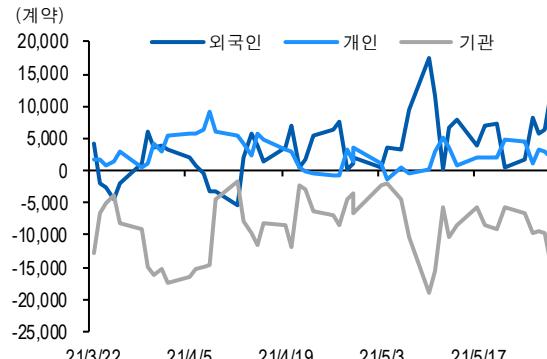
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	141.9	-1.4	140.5	-0.6	86.8	775.8	33.9	5.3	-0.2	-11.6
개인	-895.3	2.2	-893.1	0.0	-0.4	-132.9	-28.3	-2.7	-0.3	62.8
기관	740.4	4.7	745.1	29.0	18.5	-693.2	3.0	-2.3	0.9	-48.5
금융투자	584.9	54.9	639.8	12.1	6.6	-765.9	3.1	-2.9	1.8	-133.1
투신	37.3	-21.3	16.0	0.0	2.8	101.1	0.0	0.0	0.0	86.7
은행+보험+기타금융	5.9	-2.4	3.5	0.0	-1.4	-10.2	-0.1	0.6	-0.9	0.3
연기금+국가지자체	48.9	-9.5	39.4	16.8	-6.0	-18.1	0.0	0.0	0.0	-2.4
기타법인	12.9	-5.5	7.5	0.0	-0.1	50.3	-8.6	-0.3	-0.3	-2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	605,415	214.2	706,331	15.3%	지수옵션 전체	1,470,946	393.6	2,199,000						
Put	865,531	179.4	1,492,669	16.8%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	17.31%(-0.98%p)						
<hr/>														
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	430.0(K+3)	3.37	0.77	39,829	16,379	-1,228	15.3	425.0(K+1)	4.56	-2.30	11,115	11,842	3,064	15.3
	427.5(K+2)	4.50	1.07	11,973	8,923	171	15.6	422.5(K+0)	3.60	-2.05	9,503	6,833	1,026	15.6
	425.0(K+1)	5.86	1.38	8,821	12,917	498	16.0	420.0(K-1)	2.85	-1.79	22,201	19,998	1,315	16.2
	422.5(K+0)	7.41	1.64	4,721	7,452	-167	16.4	417.5(K-2)	2.25	-1.55	24,574	10,616	1,060	16.7
	420.0(K-1)	9.06	1.80	2,819	11,898	-227	16.7	415.0(K-3)	1.79	-1.32	39,794	16,080	-46	17.3

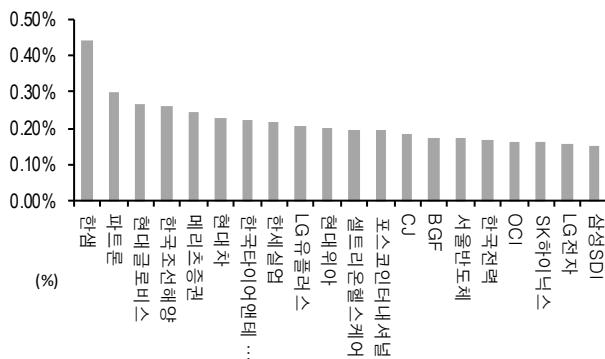
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,166,571	3,542.0	6,708,355	150,318	-20,681	62,839	-39,289	-11.6	62.8	-48.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
엔씨소프트	855,000	0.23	58.0	98.5	3,461	227	0.01%	-514	140	373
SK 텔레콤	317,500	-0.78	73.5	89.2	10,459	-556	0.04%	-944	166	779
삼성전자	80,200	0.50	840.1	85.4	1,207,361	46,677	-0.04%	-586	35,081	-34,844
호텔신라	97,500	0.31	40.1	81.2	46,979	-508	-0.03%	-2,192	-311	2,499
롯데케미칼	281,500	1.08	25.8	71.9	11,080	891	0.09%	1,129	-24	-1,115
하나금융지주	45,600	1.90	37.9	68.8	198,064	-1,887	0.07%	1,827	6,917	-8,462
SK 하이닉스	125,500	-0.79	189.4	64.9	215,152	-1,488	0.16%	-3,613	-2,558	6,188
신한지주	42,300	2.17	38.2	64.7	77,542	3,928	0.07%	7,492	-1,300	-6,150
S-Oil	95,200	-0.63	21.0	59.5	14,590	-666	0.01%	-754	-1,497	2,251
삼성 SDI	642,000	0.94	64.6	57.1	26,463	1,209	0.15%	562	232	-395

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터