

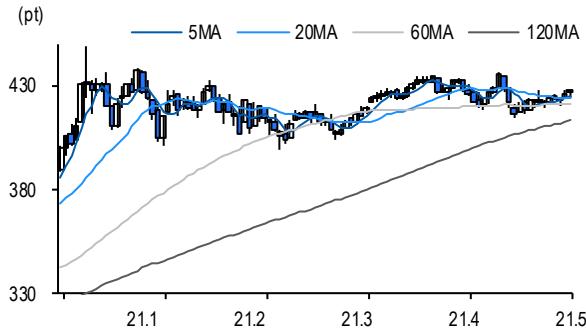


선물옵션시장 지표

2021.6.1

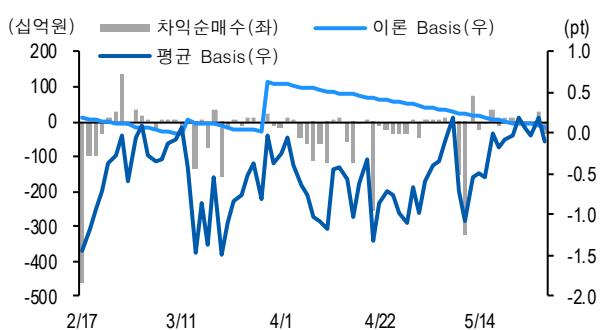
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	427.91	0.46	1.96	9,896.8	-
선물 6월물	427.70	0.32	1.35	22,168.3	245,427
선물 9월물	427.20	0.34	1.45	88.8	9,228
6월물(mini)	427.82	0.34	1.50	1,435.5	38,064
7월물(mini)	427.14	0.47	2.00	3.9	828



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.08	-0.10	-0.21	-0.04%
베이시스(mini)	0.08	-0.10	-0.09	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.58	-0.60	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.08	-0.22	-0.22	-0.07%



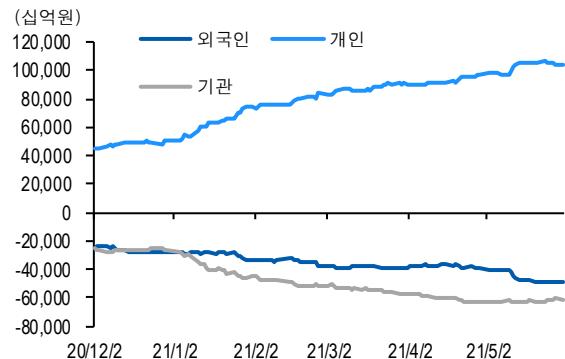
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	520.6	-14.6	506.0	-0.7	450.6	-136.0	16.3	-0.5	2.4	6.0
개인	253.1	9.4	262.5	0.0	0.3	-26.5	-14.5	0.5	-0.9	-39.5
기관	-780.6	10.9	-769.7	-30.9	-6.6	155.9	-1.3	0.1	-1.2	34.3
금융투자	-675.8	-20.9	-696.7	-3.3	-7.0	267.2	-1.3	0.5	-1.7	-12.6
투신	17.6	-9.0	8.6	0.0	-8.0	-148.9	0.0	0.0	0.0	-18.4
은행+보험+기타금융	-57.1	34.9	-22.3	0.0	-5.2	12.1	0.0	-0.4	0.5	2.5
연기금+국가지자체	-98.4	-4.6	-103.0	-27.6	16.6	25.6	0.0	0.0	0.0	62.8
기타법인	6.9	-5.7	1.1	0.0	-0.2	6.5	-0.4	-0.1	-0.4	-0.7

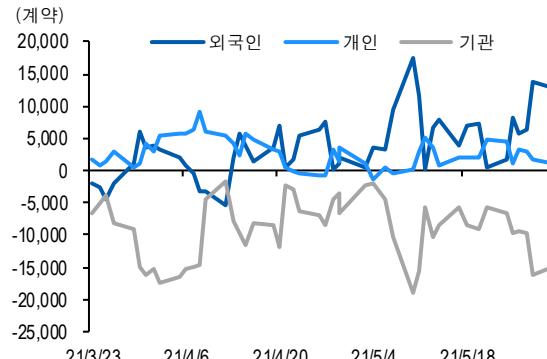
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



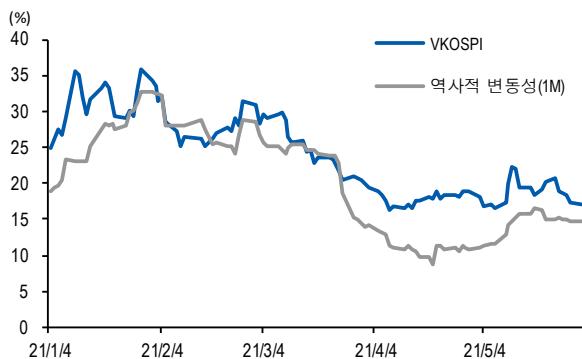
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	602,191	164.8	726,114	14.9%	지수옵션 전체	1,366,618	344.2	2,274,112						
Put	764,427	179.4	1,547,998	17.5%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	17.04%(-0.27%p)						
<hr/>														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	432.5(K+3)	2.53	0.05	54,671	14,193	1,654	14.8	Put						
	430.0(K+2)	3.49	0.12	32,580	16,956	577	14.9	427.5(K+1)	4.51	-1.18	3,728	3,237	265	16.0
	427.5(K+1)	4.71	0.21	17,164	10,420	1,497	15.1	425.0(K+0)	3.48	-1.08	11,312	11,829	-13	16.4
	425.0(K+0)	6.17	0.31	9,856	13,696	779	15.3	422.5(K-1)	2.66	-0.94	16,143	8,439	1,606	16.7
	422.5(K-1)	7.86	0.45	2,846	7,609	157	15.6	420.0(K-2)	2.05	-0.80	35,368	19,980	-18	17.3
	417.5(K-3)							417.5(K-3)	1.56	-0.69	41,153	11,090	474	17.8

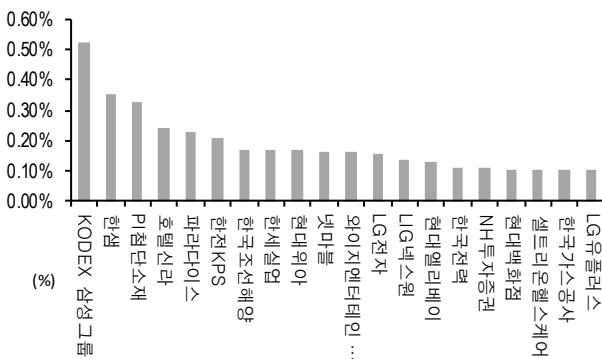
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,441,393	3,143.8	6,846,478	138,123	37,698	-86,614	49,281	6.0	-39.5	34.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
SK 텔레콤	318,000	0.16	43.4	87.3	10,736	277	0.01%	433	91	-524
한나금융지주	46,550	2.08	43.3	86.3	204,470	6,406	0.08%	3,402	-416	-2,536
엔씨소프트	868,000	1.52	51.8	73.9	3,554	93	0.00%	885	-626	-258
신한지주	42,550	0.59	39.0	69.2	85,509	7,967	0.08%	3,690	3,625	-7,275
삼성전기	169,000	0.60	56.3	63.2	34,879	680	-0.28%	-3,536	-5,702	9,640
NAVER	363,000	1.40	90.4	63.1	56,131	-293	0.03%	967	-152	-802
현대모비스	280,000	0.18	62.9	63.1	10,531	-661	0.04%	79	-455	377
POSCO	355,500	-0.28	97.3	61.9	22,184	2,484	0.03%	1,934	1,402	-3,351
SK 하이닉스	127,500	1.59	185.0	60.2	220,705	5,553	0.03%	-2,649	10,334	-7,685
현대차	235,000	1.08	158.0	59.8	107,211	-8,181	0.04%	-2,263	-2,926	5,389

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터