

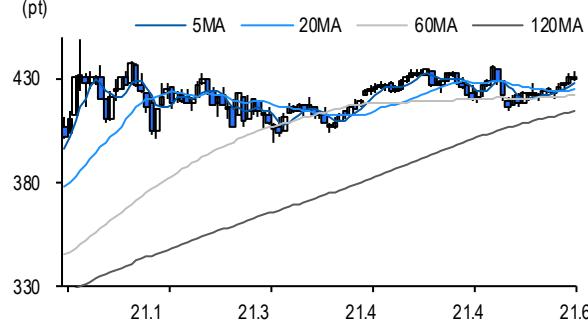


선물옵션시장 지표

2021.6.3

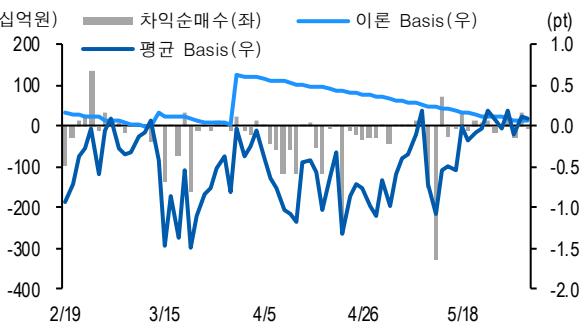
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	430.15	-0.04	-0.17	11,861.0	-
선물 6월물	429.50	-0.14	-0.60	24,746.0	246,994
선물 9월물	429.20	-0.12	-0.50	182.3	12,513
6월물(mini)	429.64	-0.11	-0.48	1,564.0	43,588
7월물(mini)	429.06	-0.13	-0.54	5.2	5,987



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.06	0.10	-0.65	0.01%
베이시스(mini)	0.06	0.10	-0.51	0.01%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.57	-0.55	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.06	-0.42	-0.42	-0.11%



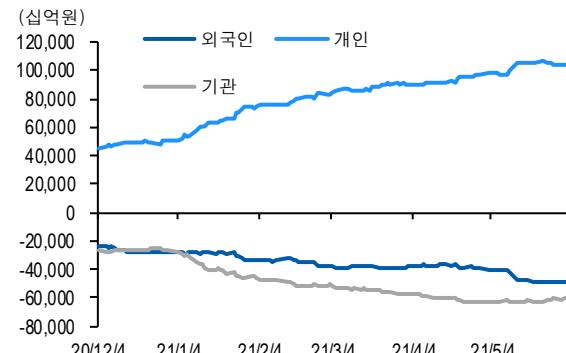
투자주체별 매매 동향

(십억원)

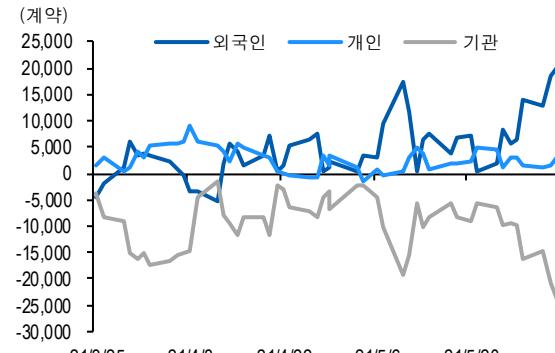
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	32.5	-0.7	31.8	-2.3	115.6	160.4	-10.0	-0.1	0.9	-22.8
개인	307.4	53.7	361.1	0.0	1.9	152.5	16.1	1.7	-1.8	-36.7
기관	-316.8	-52.7	-369.5	2.2	-118.8	-304.7	-5.6	-1.4	1.2	54.6
금융투자	-216.5	-4.9	-221.4	5.1	-27.0	93.0	-2.5	-1.4	1.3	68.1
투신	6.4	-6.3	0.2	0.0	8.2	-392.8	-2.9	0.0	-0.1	-26.5
은행+보험+기타금융	-73.7	-33.3	-107.0	-3.2	-54.8	-2.9	-0.2	-0.1	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-20.9	-3.9	-24.8	0.3	-24.4	-2.0	0.0	0.0	0.0	12.7
기타법인	-23.0	-0.3	-23.3	0.0	-0.3	-8.3	-0.5	-0.1	-0.2	4.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

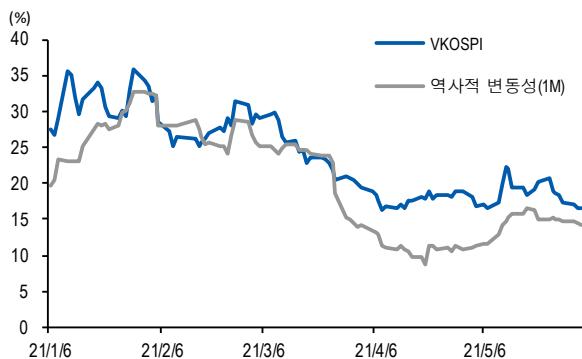
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	738,724	211.6	757,039	14.2%	지수옵션 전체	1,476,306	389.6	2,382,468							
Put	737,582	178.0	1,625,429	16.2%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	16.63% (+0.15%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	437.5(K+3)	1.26	-0.30	82,746	14,699	512	14.2	Put	432.5(K+1)	5.48	-0.02	6,715	2,378	715	15.7
	435.0(K+2)	1.87	-0.42	65,743	18,278	227	14.0		430.0(K+0)	4.12	-0.06	23,742	9,819	852	15.7
	432.5(K+1)	2.73	-0.44	32,478	14,052	390	13.9		427.5(K-1)	3.03	-0.09	38,137	6,569	1,752	15.8
	430.0(K+0)	3.85	-0.49	16,852	17,519	13	13.9		425.0(K-2)	2.17	-0.16	63,861	16,765	3,853	16.0
	427.5(K-1)	5.26	-0.53	5,410	9,943	-361	13.9		422.5(K-3)	1.56	-0.16	59,439	11,135	563	16.4

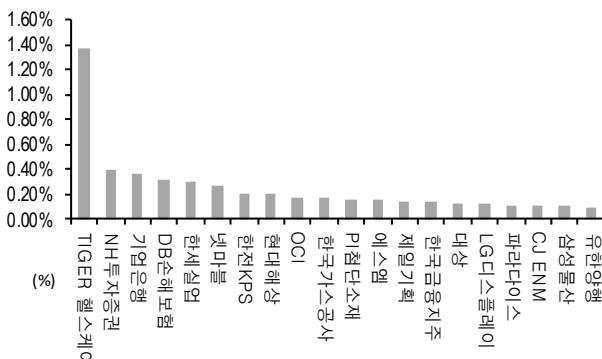
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	6,118,573	4,309.9	7,165,574	192,100	-18,950	-156,623	171,926	-22.8	-36.7	54.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
SK 텔레콤	329,500	0.30	68.9	90.2	11,197	-435	0.03%	-100	-74	174
KB 금융	58,800	0.34	51.6	88.9	64,388	8,009	0.09%	1,213	-131	-878
삼성전자	80,800	0.25	1,095.6	82.8	1,163,950	5,945	-0.02%	-545	-37,197	35,572
현대차	238,500	0.63	322.2	79.0	90,945	-13,673	0.00%	-1,040	5,349	-4,605
POSCO	352,500	0.86	155.9	73.2	18,545	-3,478	-0.12%	1,291	734	-2,039
SK 하이닉스	126,000	-2.33	251.2	68.9	214,243	-3,851	-0.06%	-2,257	-3,242	5,499
하나금융지주	46,950	1.19	43.7	68.7	201,312	-81	0.02%	-2,154	-1,717	4,172
삼성전기	174,000	-1.42	42.3	57.9	37,998	-1,366	0.05%	-3,189	504	2,693
SK 이노베이션	266,000	0.76	78.2	57.6	18,732	-2,709	-0.06%	2,168	189	-2,278
신한지주	42,900	-0.23	30.1	57.0	81,823	334	0.05%	-1,042	3,350	-2,252

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터