

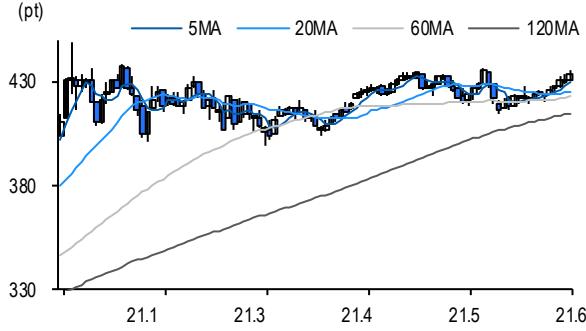


## 선물옵션시장 지표

2021.6.4

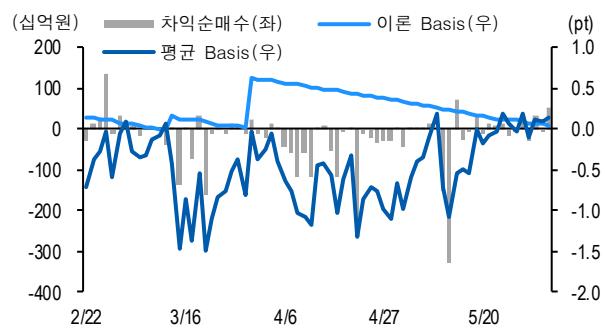
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	433.87	0.86	3.72	10,778.8	-
선물 6월물	433.45	0.92	3.95	25,162.2	251,976
선물 9월물	433.15	0.92	3.95	285.7	19,937
6월물(mini)	433.52	0.94	3.88	1,619.3	47,635
7월물(mini)	433.08	0.94	4.02	19.8	8,975



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.05	0.15	-0.42	0.02%
베이시스(mini)	0.05	0.15	-0.35	0.02%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.51	-0.50	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	-0.38	-0.38	-0.10%



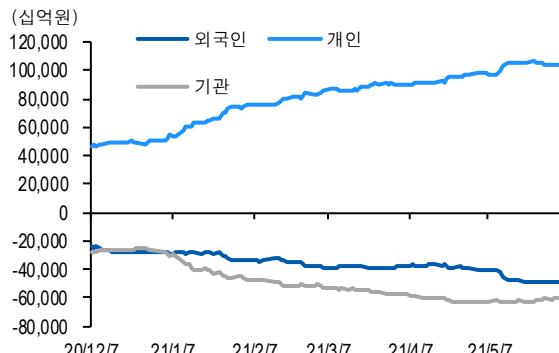
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

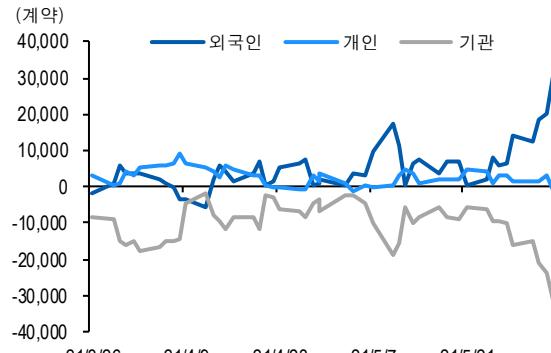
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	231.4	11.5	242.9	0.0	81.5	1,064.9	58.4	19.2	2.8	25.7
개인	-684.5	83.4	-601.1	0.0	-9.3	-343.6	-53.5	-4.7	-2.2	115.5
기관	448.9	-94.8	354.1	55.5	-113.3	-772.3	-0.2	-7.6	2.0	-137.9
금융투자	351.0	-47.3	303.7	46.7	2.0	-736.1	0.0	-6.7	2.0	-125.6
투신	-8.2	-1.5	-9.7	0.0	-71.7	-21.9	-0.2	-0.1	-0.1	46.4
은행+보험+기타금융	-6.3	-39.6	-45.9	0.0	-20.0	-0.4	0.0	-0.8	0.2	-0.1
연기금+국가지자체	108.4	-3.4	105.1	8.8	-9.2	-13.9	0.1	0.0	0.0	-58.6
기타법인	4.1	0.0	4.1	0.0	-3.1	51.0	-4.8	-6.9	-2.7	-3.4

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	1,133,155	390.3	792,228	14.3%	지수옵션 전체		1,871,387	565.1	2,460,914
Put	738,232	174.8	1,668,686	16.7%	PCR(금액기준)		0.45	VKOSPI	17.48% (+0.85%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	437.5(K+3)	2.17	0.91	113,439	15,323	624	14.3	432.5(K+1)	3.36
	435.0(K+2)	3.11	1.24	84,158	19,667	1,389	14.1	430.0(K+0)	2.41
	432.5(K+1)	4.38	1.65	24,127	13,939	-113	14.1	427.5(K-1)	1.71
	430.0(K+0)	5.90	2.05	12,255	17,680	161	14.1	425.0(K-2)	1.20
	427.5(K-1)	7.74	2.48	5,151	9,693	-250	14.4	422.5(K-3)	0.84
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	432.5(K+1)	3.36	-2.12	21,340	5,285	2,907	15.8	430.0(K+0)	2.41
	430.0(K+0)	2.41	-1.71	47,306	14,771	4,952	16.0	427.5(K-1)	1.71
	427.5(K-1)	1.71	-1.32	55,947	10,419	3,850	16.3	425.0(K-2)	1.20
	425.0(K-2)	1.20	-0.97	75,502	21,201	4,436	16.8	422.5(K-3)	0.84
	422.5(K-3)	0.84	-0.72	57,750	13,318	2,183	17.3		

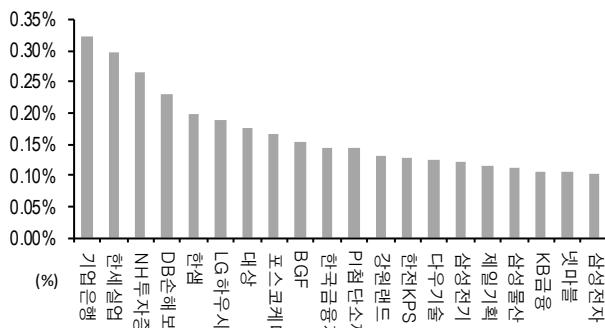
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)										
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,110,534	3,991.6	7,485,798	320,224	-58,384	116,319	-53,587	25.7	115.5	-137.9
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
하나금융지주	47,300	0.75	56.0	94.3	180,382	-20,930	-0.02%	-11,363	847	10,550
SK 텔레콤	327,000	-0.76	63.6	76.7	11,315	118	0.02%	-570	845	-275
삼성전자	82,700	2.35	1,592.0	65.7	1,332,033	168,083	0.10%	-5,095	104,257	-97,291
현대차	239,000	0.21	158.9	64.6	83,264	-7,681	-0.04%	2,629	-209	-2,410
KB금융	58,500	-0.51	45.0	64.4	63,087	-1,301	0.11%	-5,615	-2,542	7,997
기아	87,100	0.93	150.1	58.6	171,553	12,319	0.03%	4,433	1,331	-5,793
삼성 SDI	621,000	1.47	88.0	54.7	23,936	614	0.09%	1,902	258	-2,122
엔씨소프트	855,000	0.35	21.7	52.6	3,729	186	-0.31%	72	-10	-62
신한지주	42,650	-0.58	24.4	52.5	82,402	579	0.07%	-3,907	3,026	1,000
SK 하이닉스	129,000	2.38	215.1	50.1	212,358	-1,885	0.08%	4,960	3,586	-8,347

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터