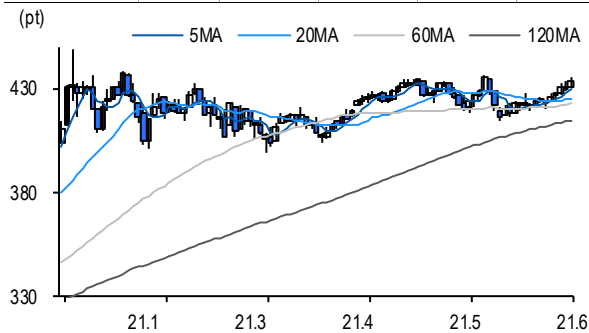


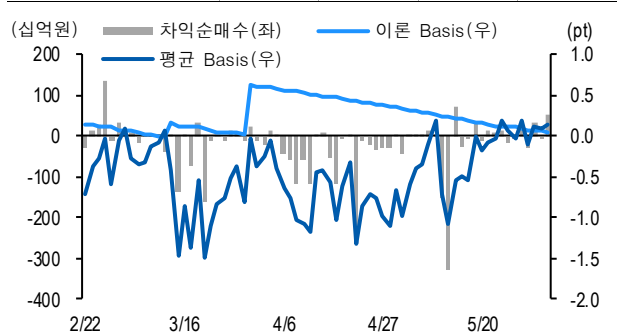
선물옵션시장 지표

2021.6.4

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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



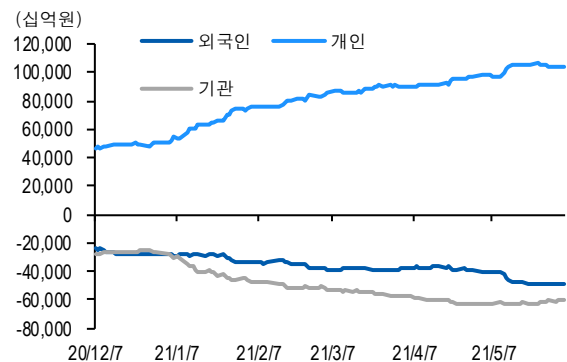
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.05	0.15	-0.42	0.02%
베이스(mini)	0.05	0.15	-0.35	0.02%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.51	-0.50	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.05	-0.38	-0.38	-0.10%



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+국가자재	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

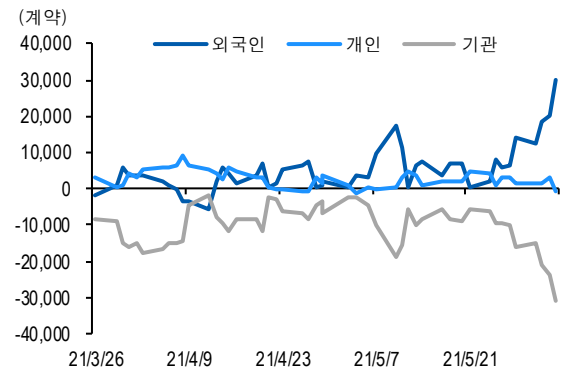
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



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)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	2.17	0.91	113,439	15,323	624	14.3	Put	432.5(K+1)	3.36	-2.12	21,340	5,285	2,907	15.8
	435.0(K+2)	3.11	1.24	84,158	19,667	1,389	14.1		430.0(K+0)	2.41	-1.71	47,306	14,771	4,952	16.0
	432.5(K+1)	4.38	1.65	24,127	13,939	-113	14.1		427.5(K-1)	1.71	-1.32	55,947	10,419	3,850	16.3
	430.0(K+0)	5.90	2.05	12,255	17,680	161	14.1		425.0(K-2)	1.20	-0.97	75,502	21,201	4,436	16.8
	427.5(K-1)	7.74	2.48	5,151	9,693	-250	14.4		422.5(K-3)	0.84	-0.72	57,750	13,318	2,183	17.3

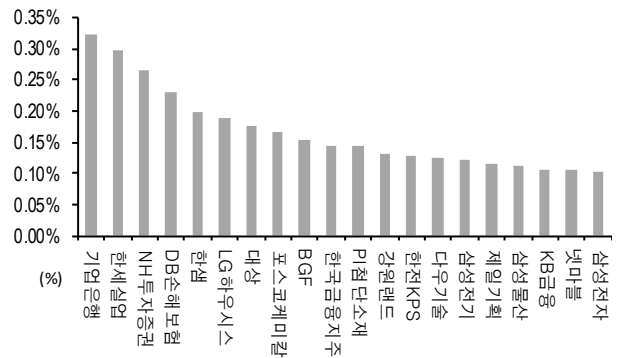
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	47,300	0.75	56.0	94.3	180,382	-20,930	-0.02%	-11,363	847	10,550	9,044	4,869
SK 텔레콤	327,000	-0.76	63.6	76.7	11,315	118	0.02%	-570	845	-275	2	-277
삼성전자	82,700	2.35	1,592.0	65.7	1,332,033	168,083	0.10%	-5,095	104,257	-97,291	-156,250	-42,209
현대차	239,000	0.21	158.9	64.6	83,264	-7,681	-0.04%	2,629	-209	-2,410	6,630	-550
KB 금융	58,500	-0.51	45.0	64.4	63,087	-1,301	0.11%	-5,615	-2,542	7,997	1,407	4,210
기아	87,100	0.93	150.1	58.6	171,553	12,319	0.03%	4,433	1,331	-5,793	-3,746	-5,063
삼성 SDI	621,000	1.47	88.0	54.7	23,936	614	0.09%	1,902	258	-2,122	-1,271	-847
엔씨소프트	855,000	0.35	21.7	52.6	3,729	186	-0.31%	72	-10	-62	182	90
신한지주	42,650	-0.58	24.4	52.5	82,402	579	0.07%	-3,907	3,026	1,000	-1,009	2,110
SK 하이닉스	129,000	2.38	215.1	50.1	212,358	-1,885	0.08%	4,960	3,586	-8,347	-8,782	-1,250

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터