

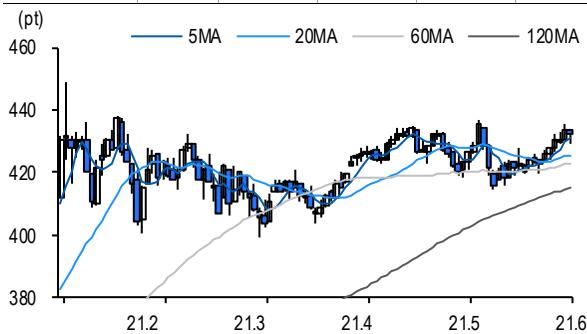


선물옵션시장 지표

2021.6.7

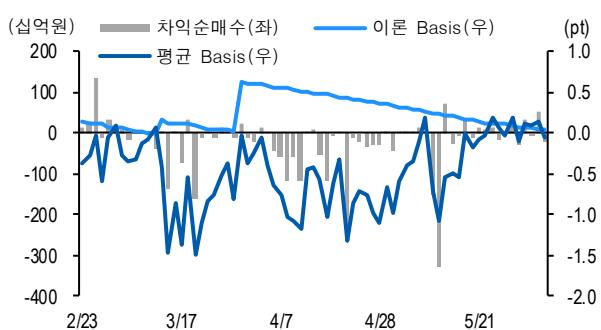
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	432.22	-0.38	-1.65	10,937.4	-
선물 6월물	432.45	-0.23	-1.00	26,553.0	250,235
선물 9월물	431.85	-0.30	-1.30	1,404.9	36,824
6월물(mini)	432.54	-0.21	-0.98	1,598.8	48,585
7월물(mini)	431.50	-0.36	-1.58	10.2	8,997



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.05	-0.05	0.23	-0.02%
베이시스(mini)	0.05	-0.05	0.32	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.52	-0.50	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	0.17	0.17	0.03%



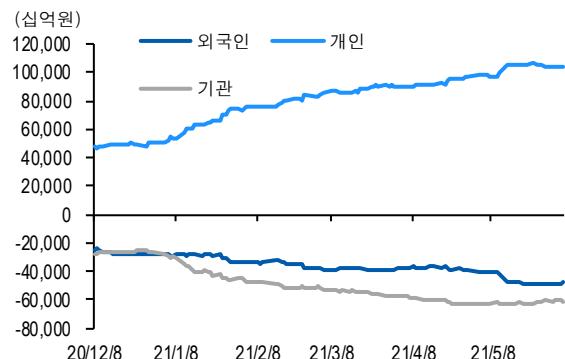
투자주체별 매매 동향

(십억원)

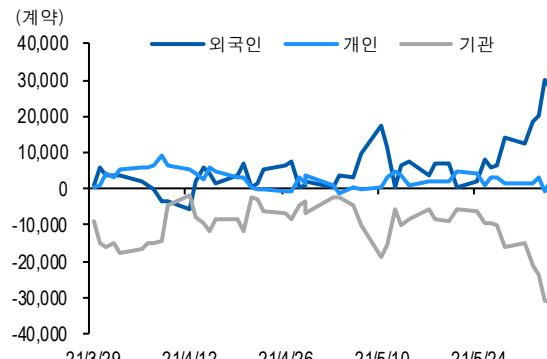
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	161.6	7.4	169.0	0.0	247.9	-366.2	-14.2	5.4	5.7	-4.9
개인	471.1	-107.5	363.6	0.0	2.9	374.3	8.2	-2.7	-2.9	-29.2
기관	-658.5	98.5	-560.0	-19.0	-38.3	5.9	1.0	0.4	-1.6	30.6
금융투자	-613.1	124.6	-488.5	0.5	-2.9	412.6	1.2	0.8	-1.4	-4.5
투신	-57.4	-20.9	-78.3	0.0	-42.3	-403.1	0.2	-0.1	0.0	-11.6
은행+보험+기타금융	17.5	1.7	19.2	0.0	-2.8	-16.5	-0.4	-0.4	-0.2	1.6
연기금+국가지자체	17.7	-0.1	17.6	-19.5	4.5	12.9	0.0	0.0	0.0	45.0
기타법인	25.9	1.6	27.4	0.0	5.8	-14.0	4.9	-3.1	-1.2	3.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

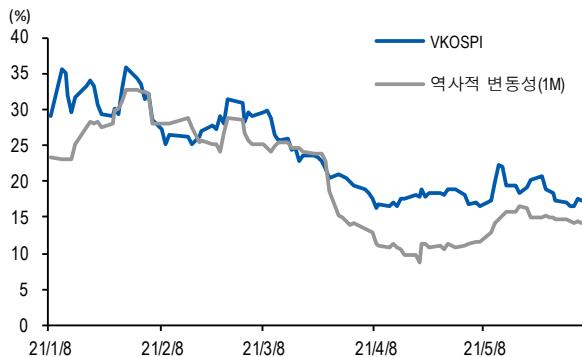
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,212,765	285.7	818,009	14.5%	지수옵션 전체	2,362,481	575.8	2,542,542
Put	1,149,716	290.1	1,724,533	15.0%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	17.43%(-0.05%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	442.5(K+3)	0.55	-0.40	135,860	29,707	1,877	14.7	437.5(K+1)
	440.0(K+2)	0.91	-0.54	180,794	29,622	2,821	14.5	435.0(K+0)
	437.5(K+1)	1.44	-0.73	138,565	17,846	2,523	14.3	432.5(K-1)
	435.0(K+0)	2.25	-0.86	124,857	20,554	887	14.4	430.0(K-2)
	432.5(K-1)	3.41	-0.97	45,487	15,837	1,898	14.7	427.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	437.5(K+1)	6.55	0.42	1,223	930	-68	13.7	
	435.0(K+0)	4.86	0.26	9,001	3,981	88	13.9	
	432.5(K-1)	3.50	0.14	24,944	7,846	2,561	14.2	
	430.0(K-2)	2.46	0.05	72,032	15,029	258	14.6	
	427.5(K-3)	1.69	-0.02	97,366	12,173	1,754	15.1	

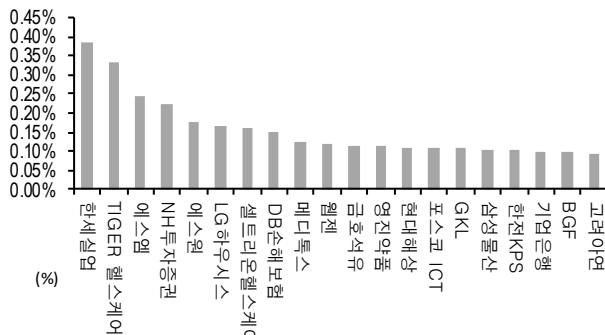
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	6,152,590	3,928.8	7,434,958	-50,840	33,473	-21,485	-21,482	-4.9	-29.2	30.6	
<hr/>											
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
하나금융지주	46,800	-1.06	52.9	91.0	162,202	-18,180	0.02%	1,533	898	-2,928	269
삼성전자	82,200	-0.60	1,249.6	84.2	1,255,194	-76,839	0.01%	-14,908	-33,572	47,418	5,807
SK 하이닉스	127,500	-1.16	225.5	69.2	208,307	-4,051	0.04%	688	-3,630	2,885	2,830
SK 텔레콤	321,000	-1.83	54.7	65.3	10,628	-687	0.00%	-1,204	579	625	34
삼성전기	178,500	-1.11	53.5	64.8	35,057	-6,716	-0.19%	-4,663	-201	4,846	2,383
현대차	242,000	1.26	202.8	63.3	84,023	759	0.03%	3,136	-6,254	2,860	1,288
신한지주	42,450	-0.47	30.8	61.7	82,934	532	0.05%	1,834	-323	-1,498	-4,664
POSCO	346,000	0.00	95.0	58.0	17,412	-21	-0.08%	-917	-191	1,088	378
호텔신라	96,800	-3.10	74.8	57.3	37,795	-3,241	-0.01%	-6,334	2,401	4,043	4,492
삼성 SDI	618,000	-0.48	62.0	57.1	22,922	-1,014	0.03%	-457	-302	757	-362
<hr/>											

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터