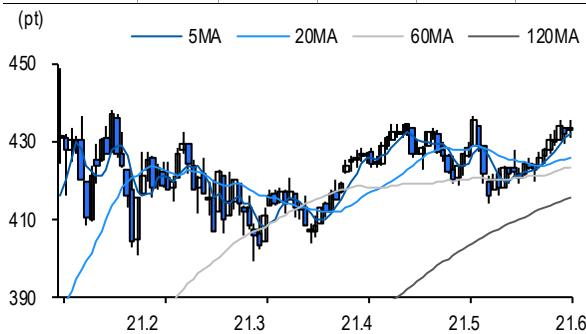


선물옵션시장 지표

2021.6.8

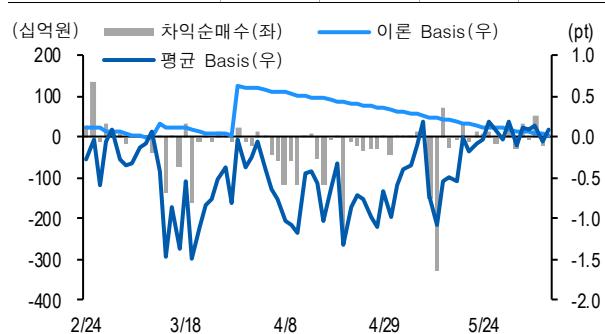
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	433.26	0.24	1.04	12,808.2	-
선물 6월물	433.65	0.28	1.20	26,338.2	223,097
선물 9월물	433.15	0.30	1.30	1,485.4	79,028
6월물(mini)	433.58	0.26	1.04	1,756.5	48,761
7월물(mini)	432.70	0.28	1.20	18.6	9,826



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.02	0.09	0.39	0.02%
베이시스(mini)	0.02	0.09	0.32	0.02%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.53	-0.50	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.02	0.31	0.31	0.07%



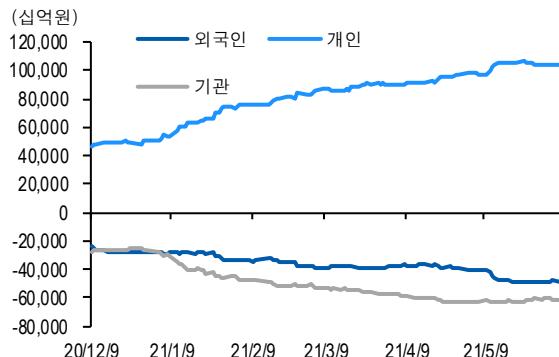
투자주체별 매매 동향

(십억원)

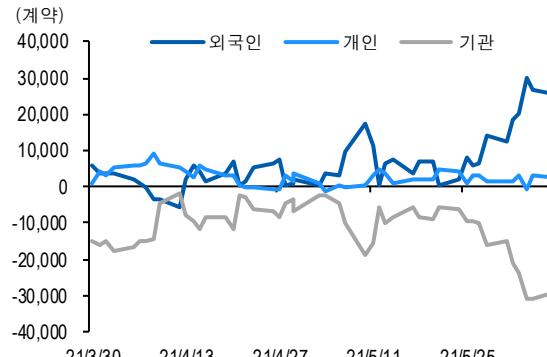
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-183.7	-23.8	-207.5	-5.7	-107.2	-114.7	-4.5	-4.1	1.5	47.5
개인	63.9	19.7	83.6	0.0	-0.3	-26.5	2.6	3.1	-0.6	18.4
기관	119.8	1.5	121.3	11.9	-17.3	143.3	1.1	2.5	-0.2	-70.1
금융투자	129.6	19.7	149.3	1.0	-5.9	138.9	-0.2	2.5	-0.3	-44.9
투신	-26.8	-5.3	-32.1	0.0	-10.7	-7.0	0.4	0.1	-0.1	-8.3
은행+보험+기타금융	-11.7	-10.3	-22.0	0.0	-4.3	25.6	0.9	0.0	0.1	4.6
연기금+국가지자체	26.2	-6.6	19.6	10.9	-0.6	-14.2	0.0	0.0	0.0	-21.6
기타법인	0.0	2.6	2.6	0.0	1.8	-2.1	0.8	-1.5	-0.7	4.2

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	1,540,649	328.5	871,411	16.5%	지수옵션 전체	2,999,331	629.4	2,662,020							
Put	1,458,682	300.9	1,790,609	16.9%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	17.04%(-0.39%p)							
<hr/>															
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	440.0(K+3)	0.75	-0.16	235,076	31,240	1,618	16.3	Put	435.0(K+1)	3.62	-1.24	25,570	6,902	2,921	14.8
	437.5(K+2)	1.34	-0.10	163,212	18,443	597	16.4		432.5(K+0)	2.43	-1.07	74,227	11,226	3,380	15.5
	435.0(K+1)	2.24	-0.01	143,771	21,342	788	16.6		430.0(K-1)	1.57	-0.89	156,706	18,877	3,848	16.2
	432.5(K+0)	3.50	0.09	59,910	16,686	849	17.1		427.5(K-2)	0.97	-0.72	164,172	17,786	5,613	16.8
	430.0(K-1)	5.17	0.32	21,924	19,692	825	18.1		425.0(K-3)	0.61	-0.54	182,878	23,878	-89	17.7

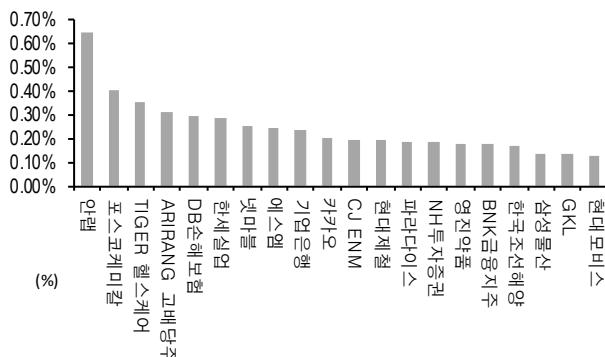
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	7,693,306	4,892.3	7,915,615	480,657	224,561	-46,664	-186,689	47.5	18.4	-70.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	129,000	1.18	405.2	122.9	192,752	-15,555	0.07%	298	-2,556	2,509	2,658	490
한나금융지주	47,050	0.53	43.0	104.3	153,355	-8,847	0.05%	-218	-41	163	346	-2,755
호텔신라	97,400	0.62	58.1	101.6	33,723	-4,072	-0.09%	6,054	-228	-5,771	1,519	-76
SK 텔레콤	323,500	0.78	75.8	93.9	12,350	1,722	0.06%	1,846	595	-2,444	-108	-2,336
삼성전자	82,100	-0.12	1,069.5	80.2	1,028,254	-226,940	-0.08%	3,568	5,718	-9,156	9,603	-2,400
삼성전기	179,500	0.56	53.0	75.4	33,648	-1,409	0.03%	-1,084	4,436	-4,390	-2,855	-1,434
삼성 SDI	624,000	0.97	54.3	67.1	18,732	-4,190	0.05%	-744	-180	931	170	751
신한지주	42,800	0.82	28.6	64.6	70,479	-12,455	0.04%	7,894	-816	-7,088	-9,814	2,815
현대차	241,000	-0.41	194.8	59.6	76,491	-7,532	0.13%	-7,994	5,178	2,725	-1,492	2,249
KB 금융	58,100	0.52	27.4	58.1	57,225	-4,329	0.02%	1,738	-1,074	-689	-1,250	3,082

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터