

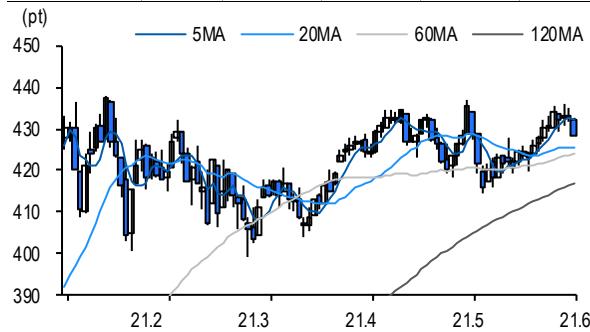


## 선물옵션시장 지표

2021.6.10

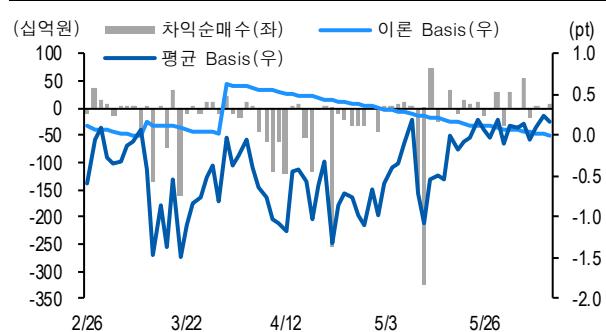
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	428.16	-1.09	-4.72	10,849.9	-
선물 6월물	428.30	-1.07	-4.65	24,675.3	118,724
선물 9월물	427.40	-1.11	-4.80	3,713.0	198,010
6월물(mini)	428.28	-1.08	-4.76	1,936.0	47,017
7월물(mini)	427.22	-1.11	-4.78	43.0	14,100



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.01	0.17	0.14	0.04%
베이시스(mini)	0.01	0.18	0.12	0.04%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.67	-0.75	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.01	0.08	0.08	0.02%



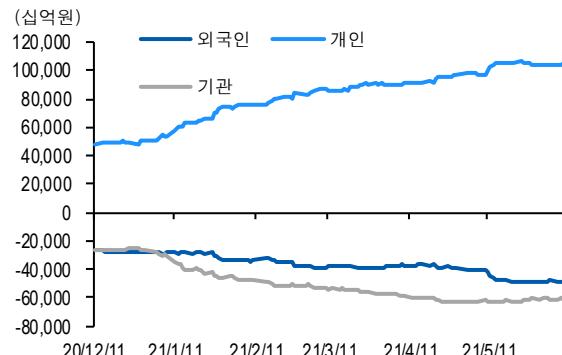
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-329.8	29.0	-300.8	-0.9	-137.4	-76.6	-70.3	1.6	2.8	99.6
개인	787.8	10.9	798.7	0.0	-5.3	110.5	80.4	-1.7	0.8	-105.5
기관	-458.5	-51.7	-510.2	8.9	-51.3	14.1	-21.4	3.2	-2.8	5.5
금융투자	-260.5	-69.1	-329.7	-7.4	-0.6	343.4	-20.0	3.7	-2.8	59.1
투신	-58.3	0.8	-57.4	9.6	-17.6	-300.4	-1.3	-0.4	0.0	-37.5
은행+보험+기타금융	-19.9	27.9	8.0	0.0	-5.5	-0.7	-0.1	-0.1	0.0	-1.4
연기금+국가지자체	-48.2	-1.8	-49.9	6.6	1.1	-28.1	0.0	0.0	0.0	-14.7
기타법인	0.4	11.8	12.3	0.0	0.7	-47.9	11.2	-3.1	-0.7	0.5

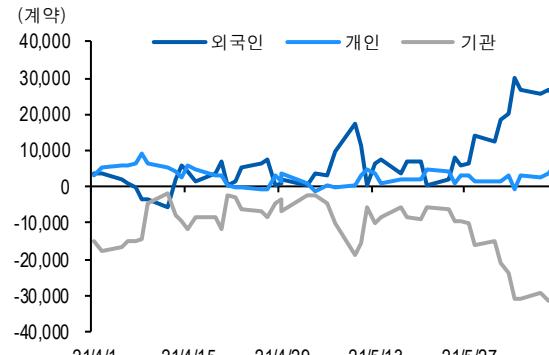
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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
Call	1,533,659	260.9	980,357	14.6%	지수옵션 전체	3,279,414	588.2
Put	1,745,755	327.3	1,856,398	14.2%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI 16.58% (+0.34%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	0.03	-0.26	183,408	34,552	982	17.0	Put	435.0(K+1)	6.86	3.38	19,453	7,905	-482	11.0
	437.5(K+2)	0.05	-0.65	277,864	25,169	3,822	15.1		432.5(K+0)	4.60	2.50	98,153	16,508	2,950	12.4
	435.0(K+1)	0.10	-1.32	374,829	36,521	15,254	13.4		430.0(K-1)	2.71	1.54	236,477	21,385	-768	12.9
	432.5(K+0)	0.34	-2.21	264,845	32,457	12,679	13.3		427.5(K-2)	1.43	0.76	307,720	17,687	-1,452	13.8
	430.0(K-1)	0.97	-3.16	123,006	25,882	6,148	13.7		425.0(K-3)	0.71	0.35	335,699	28,399	3,559	15.0

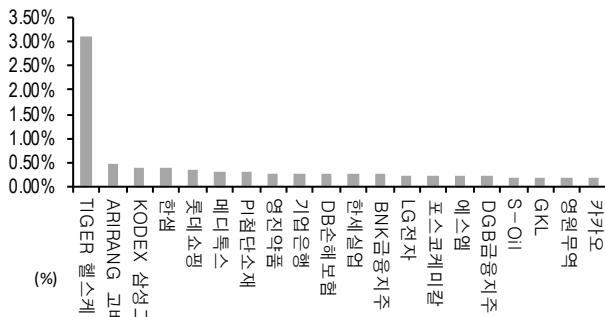
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	6,878,983	4,668.6	8,065,517	130,643	131,061	-143,413	13,308	99.6	-105.5	5.5
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
하나금융지주	46,050	-1.92	50.7	122.3	99,446	-44,967	0.00%	-451	7,043	-7,673
SK 텔레콤	328,000	0.00	91.1	101.9	10,811	-1,051	0.10%	212	74	-287
KB 금융	57,000	-1.55	37.1	79.8	36,321	-17,894	-0.01%	4,830	-1,465	-3,453
현대차	240,000	-1.64	176.4	77.7	59,362	-10,745	0.12%	-2,400	139	2,283
삼성전자	81,300	-0.85	921.6	76.0	670,912	-264,518	-0.12%	26,626	-43,139	16,376
신한지주	42,100	-1.41	30.9	75.3	59,119	-7,766	0.00%	-7	-788	704
KT	33,450	-0.45	24.0	65.1	38,858	-12,377	0.07%	1,336	1,981	-3,322
기아	90,300	-1.42	179.7	63.8	150,115	-19,394	0.08%	-2,512	-8,160	10,804
엔씨소프트	856,000	0.82	40.4	60.1	2,762	-522	-0.13%	506	-454	-52
SK 하이닉스	122,500	-3.92	439.4	59.3	132,958	-36,104	-0.18%	13,116	-42,370	29,364

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터