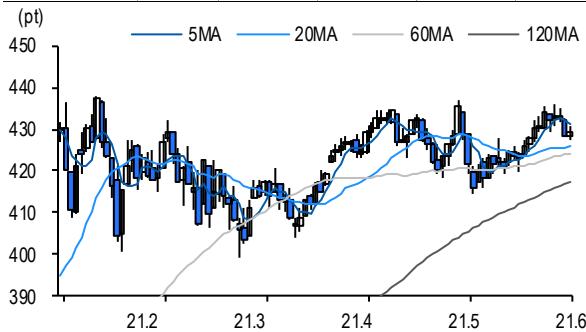


선물옵션시장 지표

2021.6.11

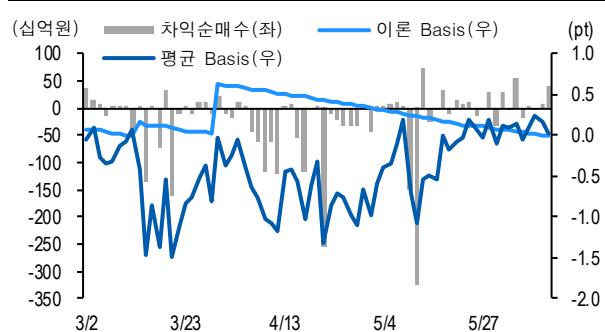
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.35	0.28	1.19	13,362.1	-
선물 6월물	429.90	0.37	1.60	13,702.0	0
선물 9월물	428.85	0.34	1.45	8,548.6	215,183
6월물(mini)	429.98	0.39	1.70	908.4	0
7월물(mini)	428.58	0.32	1.36	710.9	22,429



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	0.02	0.55	0.00%
베이시스(mini)	0.00	0.02	0.63	0.00%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.65	-0.55	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.59	0.59	0.14%



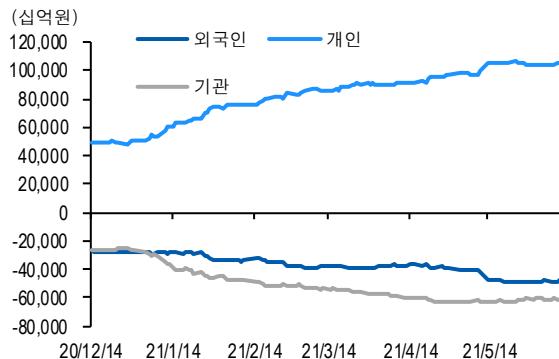
투자주체별 매매 동향

(십억원)

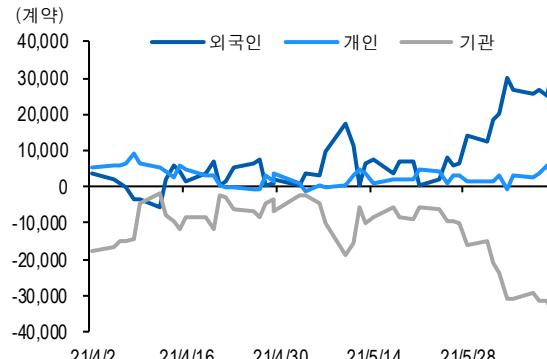
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	710.1	-32.6	677.5	-0.1	767.2	784.8	88.3	-2.5	-1.3	8.5
개인	387.5	-44.6	342.9	0.0	4.9	-388.2	-38.9	2.2	4.1	64.0
기관	-1,115.4	73.5	-1,041.9	42.7	-864.0	-407.2	-50.0	1.2	-1.9	-72.8
금융투자	-839.7	24.6	-815.1	59.7	-729.6	-494.8	-49.6	1.3	-0.6	-6.7
투신	-21.4	23.4	2.1	0.0	-64.9	148.7	-0.2	-1.8	0.1	-38.2
은행+보험+기타금융	-3.0	10.3	7.3	0.0	1.6	-35.7	-0.2	1.7	-1.4	0.3
연기금+국가지자체	-325.2	-1.1	-326.3	-17.1	-107.3	-25.4	0.0	0.0	0.0	-28.1
기타법인	17.8	3.7	21.5	0.0	1.2	10.6	0.7	-0.9	-0.9	0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

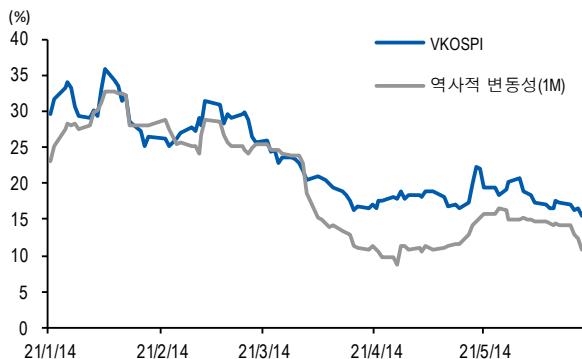
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,691,354	285.1	401,013	8.9%	지수옵션 전체	3,491,011	515.5	1,082,218
Put	1,799,657	230.4	681,205	8.0%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	15.44%(-1.14%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	435.0(K+3)	0.01	-0.09	200,178	0	-36,521	11.0	Put
	432.5(K+2)	0.02	-0.32	591,356	0	-32,457	7.4	
	430.0(K+1)	0.30	-0.67	493,020	0	-25,882	6.3	
	427.5(K+0)	2.46	0.26	140,462	0	-13,307	14.9	
	425.0(K-1)	4.95	0.98	21,213	0	-12,892	23.4	

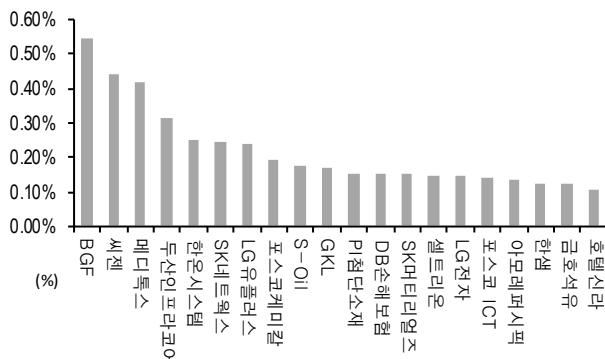
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	7,490,425	5,660.1	6,105,499	-1,960,018	-71,407	78,829	-2,310	8.5	64.0	-72.8
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
한세실업	23,950	-2.44	6.2	72.2	0	-17,546	-0.07%	498	549	-1,053
호텔신라	100,000	0.20	40.0	65.6	0	-23,744	0.11%	-3,194	2,895	217
하나금융지주	46,250	0.43	49.4	63.8	0	-99,446	-0.05%	5,551	3,209	-9,062
에스엠	45,100	1.12	26.0	51.9	0	-42,843	-0.01%	-986	2,955	-1,817
SK 하이닉스	123,500	0.82	244.1	44.1	0	-132,958	-0.23%	4,761	-2,117	-2,774
기아	89,400	-1.00	95.2	43.8	0	-150,115	-0.05%	-2,055	-784	2,224
삼성전자	81,200	-0.12	526.6	37.0	0	-670,912	-0.09%	6,438	-7,140	115
현대위아	90,500	-0.22	15.7	36.1	0	-14,739	-0.07%	-657	-415	1,125
현대차	237,500	-1.04	92.4	35.8	0	-59,362	-0.03%	1,320	3,177	-4,982
신세계	306,500	-0.33	8.1	34.2	0	-2,966	0.09%	-60	-8	72

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터