

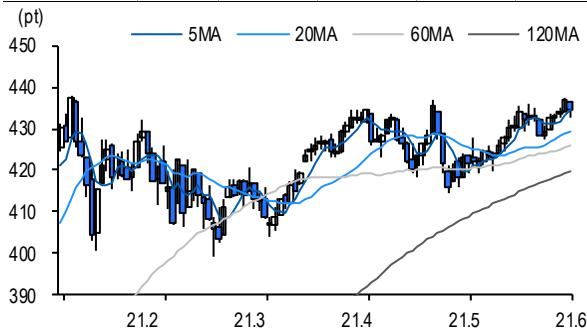


선물옵션시장 지표

2021.6.18

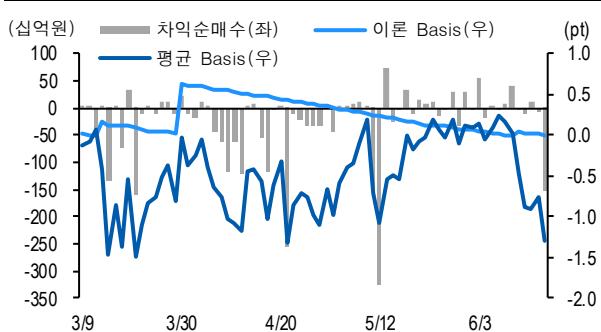
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.73	-0.51	-2.23	9,593.4	-
선물 9월물	432.85	-0.76	-3.30	19,954.1	223,352
선물 12월물	432.80	-0.64	-2.80	19.6	27,871
7월물(mini)	432.76	-0.71	-3.08	1,791.2	48,641
8월물(mini)	433.40	-0.55	-2.40	2.8	366



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	-1.29	-1.88	-0.30%
베이시스(mini)	-0.49	-1.38	-1.97	-0.20%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.46	-0.45	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.49	-1.83	-1.83	-0.31%



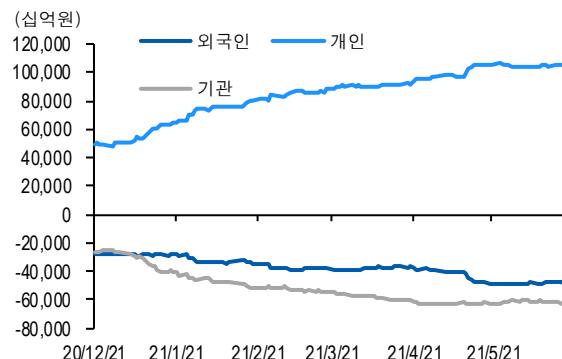
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-343.0	4.0	-338.9	-16.6	-173.5	-600.4	-17.2	-1.2	3.8	-19.6
개인	1,032.4	-46.5	985.9	0.0	-5.0	224.6	2.1	0.3	-2.8	-25.3
기관	-688.5	40.3	-648.2	-137.8	-63.8	455.8	11.3	0.8	-0.7	46.9
금융투자	-507.8	13.6	-494.2	-105.9	-73.9	780.0	11.5	-0.2	1.2	40.0
투신	-98.3	-1.3	-99.6	0.0	-34.4	-361.0	-0.3	-0.3	0.0	-11.5
은행+보험+기타금융	-2.4	7.7	5.3	0.0	16.0	-0.8	0.0	1.3	-2.0	0.6
연기금+국가지자체	-28.8	4.9	-23.9	-31.9	50.4	37.6	0.0	0.0	0.0	17.8
기타법인	-0.9	2.2	1.3	0.0	-0.2	-80.1	3.8	0.1	-0.3	-2.0

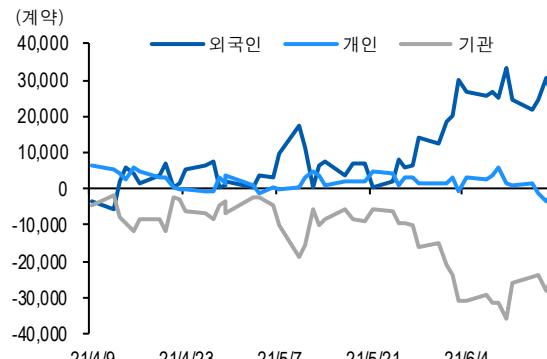
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	353,226	115.0	529,095	11.7%	지수옵션 전체	779,126	268.6
Put	425,900	153.6	931,037	15.0%	PCR(금액기준)	1.34	VKOSPI 14.98% (+0.28%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	445.0(K+3)	1.42	-0.76	41,963	12,848	596	11.8
	442.5(K+2)	1.94	-0.97	34,101	12,899	1,113	11.7
	440.0(K+1)	2.61	-1.21	25,874	10,563	167	11.6
	437.5(K+0)	3.47	-1.43	14,902	8,218	695	11.5
	435.0(K-1)	4.47	-1.71	7,880	8,725	920	11.4
Put	440.0(K+1)	9.53	1.68	428	764	95	14.6
	437.5(K+0)	8.07	1.57	2,171	1,188	115	14.8
	435.0(K-1)	6.71	1.42	4,017	3,033	453	14.9
	432.5(K-2)	5.47	1.23	5,730	5,935	276	14.9
	430.0(K-3)	4.44	0.97	7,859	5,908	336	15.0

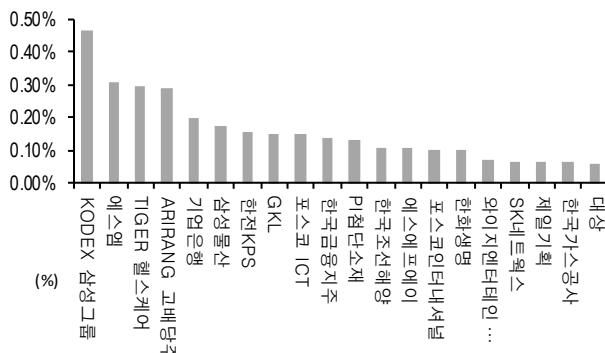
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,578,427	3,092.9	7,094,715	75,460	-72,549	46,147	25,866	-19.6	-25.3	46.9	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
호텔신라	99,600	1.43	43.6	77.6	45,874	-825	0.01%	1,118	-2,154	1,086	-1,802
NAVER	389,000	-0.51	195.8	75.2	57,241	-2,096	-0.06%	-4,339	-200	4,586	5,423
삼성 SDI	651,000	-0.76	108.1	71.2	29,075	1,543	0.01%	-545	682	-137	-243
현대차	235,000	-2.08	113.6	66.4	91,027	-10,309	-0.41%	643	-8,660	8,297	8,930
삼성전기	176,500	0.28	27.5	62.1	26,543	136	0.03%	270	1,968	-2,234	-377
카카오	148,500	3.48	478.5	60.8	229,969	1,712	0.05%	2,635	513	-2,776	-1,536
기아	87,600	-1.90	98.6	57.9	141,531	-23,240	0.00%	-7,901	-19,535	28,076	8,579
SK 하이닉스	126,500	-1.94	152.8	57.3	175,112	3,668	-0.09%	-1,308	1,694	-389	9,161
한국전력	26,950	0.94	46.5	56.3	363,231	-1,238	0.05%	20,362	-5,107	-15,352	-7,110
SK 텔레콤	327,500	-0.30	40.1	55.5	10,785	658	-0.13%	593	103	-699	6

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터