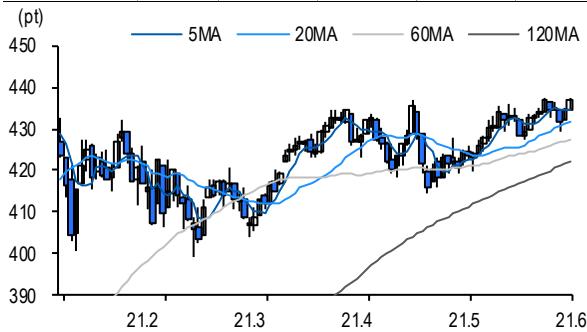


선물옵션시장 지표

2021.6.24

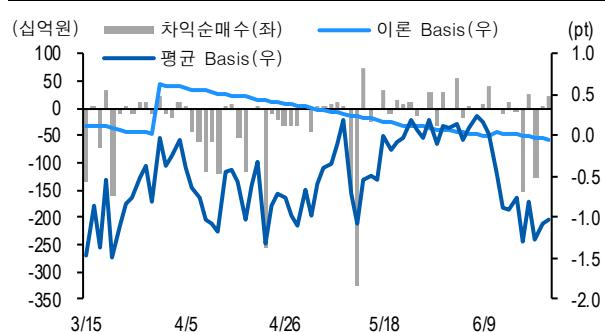
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	436.73	0.53	2.31	12,635.0	-
선물 9월물	435.85	0.57	2.45	16,333.6	231,296
선물 12월물	435.35	0.58	2.50	15.4	28,487
7월물(mini)	435.62	0.56	2.42	1,755.3	67,694
8월물(mini)	435.50	0.49	2.12	2.4	584



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-0.04	-1.04	-0.88	-0.23%
베이시스(mini)	-0.54	-1.26	-1.11	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.50	-0.50	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.54	-1.11	-1.11	-0.13%



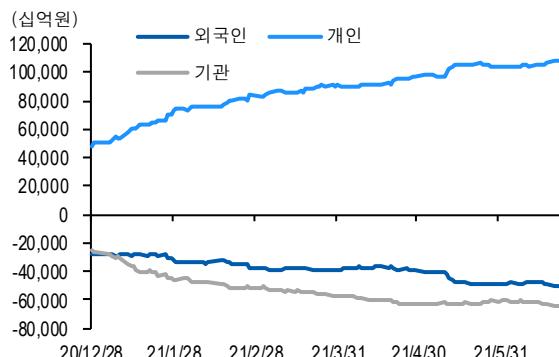
투자주체별 매매 동향

(십억원)

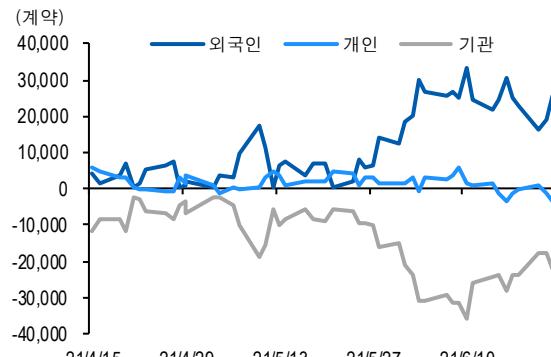
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-9.7	-3.7	-13.4	-0.7	90.7	702.7	-10.7	-6.7	-0.8	39.0
개인	82.8	17.0	99.8	0.0	-10.7	-219.5	-22.6	3.1	-0.4	39.2
기관	-29.5	-13.1	-42.5	24.3	-167.3	-481.6	50.3	3.5	1.5	-81.5
금융투자	128.1	59.3	187.4	-1.8	-21.5	-405.1	49.2	3.6	1.3	-99.1
투신	-75.3	1.1	-74.2	0.0	-59.0	-4.8	-0.2	0.0	0.1	24.3
은행+보험+기타금융	-22.7	-101.3	-124.1	0.0	9.7	-38.6	1.2	-0.1	0.1	-3.3
연기금+국가지자체	12.1	-7.7	4.4	26.1	-27.9	-33.1	0.0	0.0	0.0	-3.4
기타법인	-43.6	-0.3	-43.9	0.0	3.2	-1.6	-17.0	0.0	-0.4	3.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	460,063	160.3	589,693	11.7%	지수옵션 전체	941,130	282.0
Put	481,067	121.6	1,037,979	14.4%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI 14.75%(-0.36%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	1.84	0.42	53,803	16,384	-33	11.6
	440.0(K+2)	2.65	0.58	56,183	15,598	618	11.7
	437.5(K+1)	3.65	0.75	22,991	10,823	921	11.7
	435.0(K+0)	4.94	0.99	13,247	10,856	1,488	11.9
	432.5(K-1)	6.49	1.22	9,531	6,772	-1,313	12.1
Put	437.5(K+1)	5.53	-1.68	2,968	1,632	196	13.3
	435.0(K+0)	4.32	-1.48	7,264	4,770	774	13.5
	432.5(K-1)	3.36	-1.25	11,427	6,638	-216	13.8
	430.0(K-2)	2.59	-1.05	17,979	8,834	1,328	14.1
	427.5(K-3)	2.00	-0.88	21,308	6,835	751	14.5

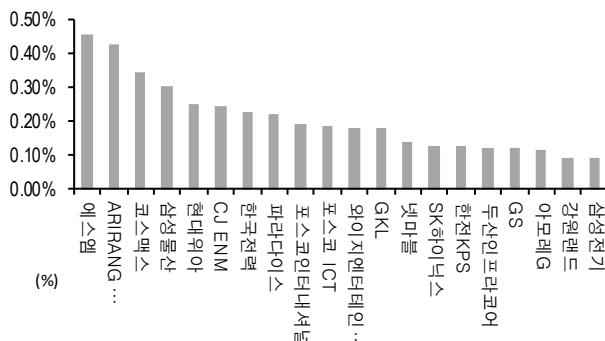
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역사적 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	4,436,420	4,321.8	7,324,561	55,627	-11,112	28,603	-15,434	39.0	39.2	-81.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KT	32,450	-0.61	19.5	71.1	90,120	398	0.08%	-2,520	2,672	-153	-2,199	2,046
기아	90,400	0.44	124.4	65.8	155,342	8,159	0.03%	1,115	-205	-869	5,092	-6,003
NAVER	424,500	8.57	718.6	64.0	72,906	13,774	0.05%	5,748	7,532	-13,952	-12,566	-5,713
카카오	170,000	6.58	939.2	62.7	237,171	5,671	-0.07%	-2,456	-5,785	8,318	4,408	2,189
삼성 SDI	685,000	0.15	106.2	61.0	32,476	1,826	0.07%	-521	1,862	-1,733	-1,038	-695
신한지주	40,250	-0.98	22.2	55.6	68,413	4,278	-0.34%	-975	470	625	815	-190
현대차	242,500	0.41	111.2	55.1	90,263	572	-0.35%	528	1,596	-2,047	-2,549	520
SK 텔레콤	325,000	1.40	32.4	54.7	10,590	-227	-0.09%	627	-968	331	217	114
LG 전자	158,000	-0.94	94.1	54.7	57,188	38	0.02%	870	-957	779	295	-1,202
LG 화학	834,000	-0.36	97.7	53.3	14,205	-317	-0.09%	-183	-1,006	1,189	164	684

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터