

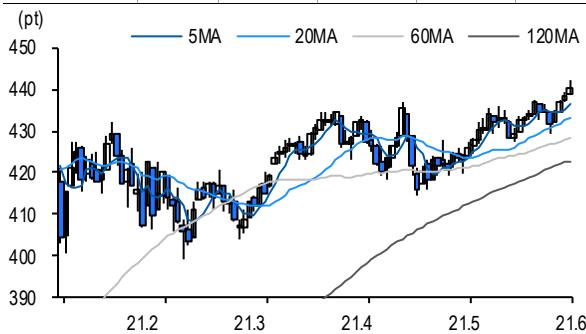


선물옵션시장 지표

2021.6.28

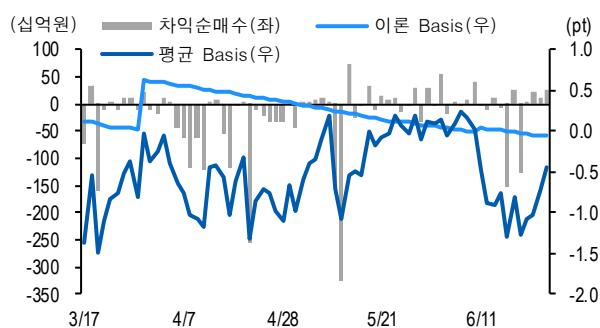
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	440.40	0.46	2.02	13,475.5	-
선물 9월물	439.70	0.46	2.00	18,621.3	234,614
선물 12월물	439.25	0.50	2.20	21.0	28,521
7월물(mini)	439.36	0.46	2.00	1,763.0	69,009
8월물(mini)	439.48	0.51	2.22	5.4	768



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-0.05	-0.45	-0.70	-0.09%
베이시스(mini)	-0.55	-0.73	-1.04	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.50	-0.05	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.55	-1.05	-1.05	-0.11%



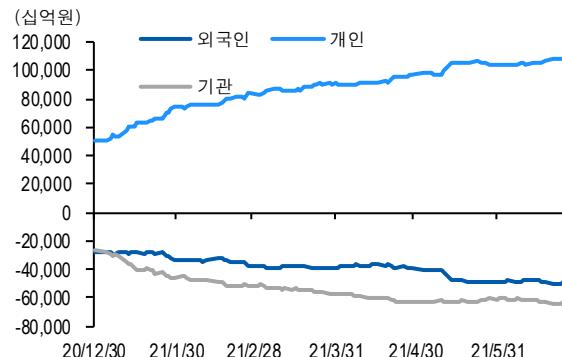
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	244.9	15.3	260.1	-5.4	231.7	143.1	-42.2	-2.0	0.6	12.8
개인	-819.1	26.2	-792.9	0.0	-5.5	170.8	21.2	4.7	-3.6	14.9
기관	589.0	-46.1	542.9	30.4	-20.8	-342.5	-3.9	-2.8	3.2	-30.9
금융투자	566.9	51.0	618.0	-1.5	-8.1	-146.1	-9.2	-2.6	3.1	-54.3
투신	-13.8	-17.0	-30.8	0.0	-13.5	-93.3	3.8	-0.2	0.0	57.2
은행+보험+기타금융	-3.7	-65.2	-68.9	0.0	-9.4	-64.2	1.5	0.0	0.2	-2.5
연기금+국가지자체	47.9	-5.9	42.0	31.9	14.9	-38.9	0.0	0.0	0.0	-31.3
기타법인	-14.8	4.6	-10.1	0.0	0.4	28.6	24.9	0.1	-0.1	3.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



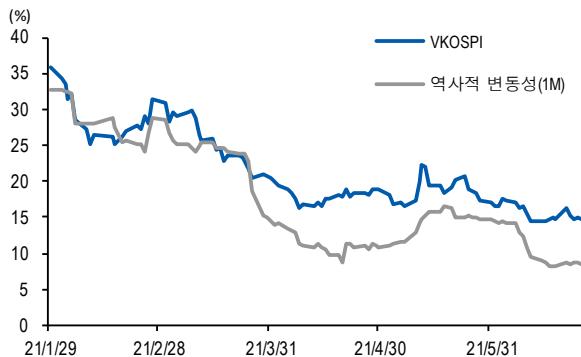
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	798,424	261.3	627,924	11.9%	지수옵션 전체	1,434,778	404.8	1,744,904
Put	636,354	143.5	1,116,980	14.1%	PCR(금액기준)	0.55	VKOSPI	14.82%(-0.02%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	445.0(K+3)	2.03	0.45	89,928	18,050	-389	11.9	440.0(K+1)
	442.5(K+2)	2.89	0.59	49,762	16,482	-620	11.8	437.5(K+0)
	440.0(K+1)	4.00	0.76	28,412	15,853	-18	11.8	435.0(K-1)
	437.5(K+0)	5.36	0.94	9,299	11,730	560	11.9	432.5(K-2)
	435.0(K-1)	7.02	1.14	5,169	10,819	-297	12.1	430.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	440.0(K+1)	4.66	-1.15	10,018	3,318	1,698	13.4	
	437.5(K+0)	3.51	-0.98	16,675	5,676	2,131	13.4	
	435.0(K-1)	2.66	-0.80	28,990	8,059	1,212	13.7	
	432.5(K-2)	2.00	-0.66	41,568	9,570	1,658	14.1	
	430.0(K-3)	1.48	-0.56	53,557	16,387	5,956	14.5	

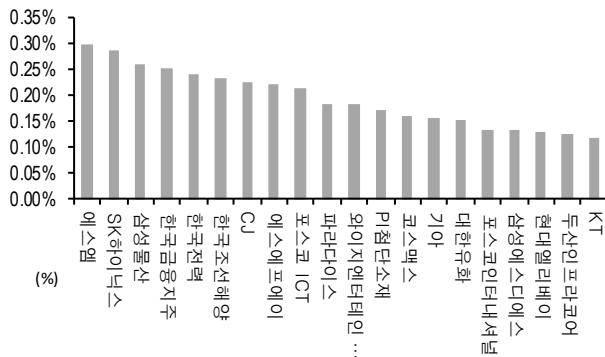
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,458,995	3,946.5	7,442,285	47,841	137,447	18,042	-166,128	12.8	14.9	-30.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
NAVER	410,000	-2.26	444.5	78.6	69,228	-625	0.02%	939	769	-1,713
호텔신라	98,400	2.71	50.3	66.4	40,125	-408	0.02%	1,375	-1,780	405
삼성전자	81,300	0.62	680.5	64.2	1,310,831	6,604	0.08%	11,682	14,998	-26,743
KT	32,550	0.93	16.0	63.9	92,889	-733	0.12%	1,942	-1,031	-913
현대제철	54,400	-1.45	55.8	60.9	27,937	-18,345	-0.03%	-9,305	-776	10,073
하나금융지주	47,050	3.63	39.7	59.4	159,930	16,985	0.05%	9,154	-2,630	-5,471
POSCO	349,000	0.29	117.2	57.3	18,521	-3,131	-0.64%	-3,782	-1,785	5,479
기아	90,900	0.00	92.1	55.9	180,092	-1,126	0.16%	2,989	-232	-2,760
SK 이노베이션	289,500	-1.36	116.3	54.6	27,088	-2,941	-0.06%	-2,402	-1,506	3,913
삼성 SDI	688,000	-0.29	89.5	52.4	33,347	216	0.06%	-292	-403	685

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터