

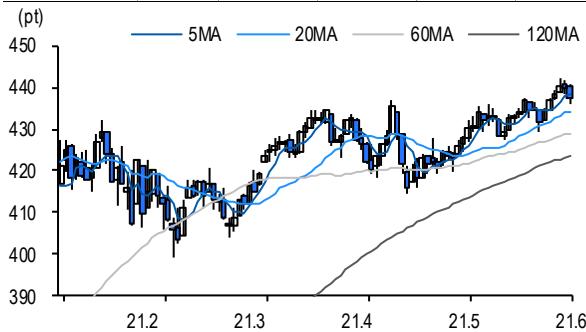


선물옵션시장 지표

2021.6.30

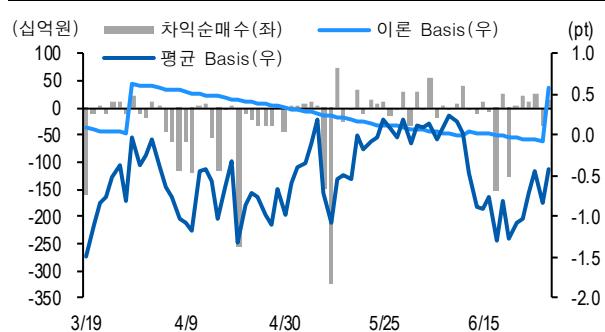
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	437.54	-0.55	-2.44	9,587.1	-
선물 9월물	437.05	-0.41	-1.80	14,806.4	234,455
선물 12월물	436.70	-0.44	-1.95	13.2	28,523
7월물(mini)	436.98	-0.40	-1.74	1,839.5	63,047
8월물(mini)	436.90	-0.46	-2.00	5.1	811



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.59	-0.42	-0.49	-0.23%
베이시스(mini)	0.07	-0.47	-0.56	-0.12%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.33	-0.35	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	-0.57	-0.57	-0.15%



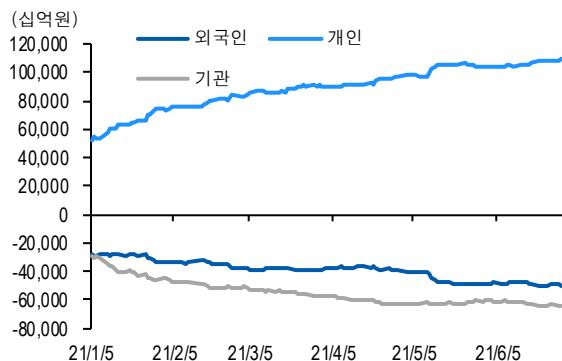
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-549.8	-21.1	-570.8	-7.7	-281.3	-938.1	136.5	-7.5	-4.6	4.0
개인	1,232.1	-7.2	1,225.0	0.0	2.8	259.4	-2.7	0.7	-0.4	10.0
기관	-681.1	32.2	-648.9	23.8	-50.8	665.7	-140.5	-2.2	2.3	-15.3
금융투자	-450.5	-20.7	-471.3	-11.2	-19.5	540.0	-138.9	-2.3	2.3	-8.0
투신	-95.0	-4.8	-99.8	0.0	-33.4	157.8	-1.6	0.0	0.0	-5.8
은행+보험+기타금융	-3.1	37.7	34.5	0.0	-5.7	9.4	0.2	0.0	0.0	5.1
연기금+국가지자체	-57.7	-1.6	-59.3	34.9	7.2	-41.5	-0.1	0.0	0.0	-6.7
기타법인	-1.3	-4.0	-5.3	0.0	2.1	13.0	6.7	9.1	2.6	1.3

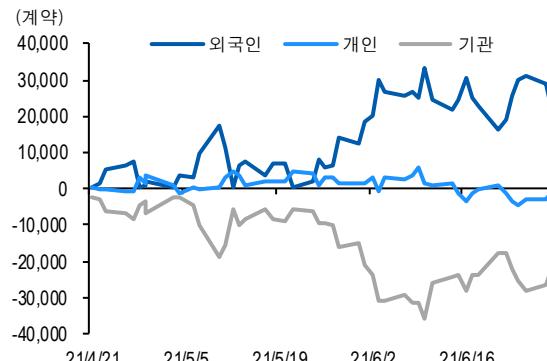
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



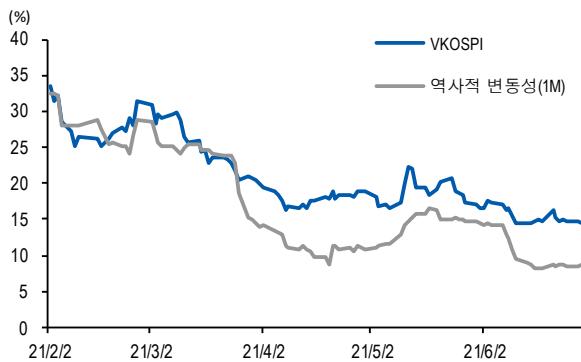
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	568,026	144.8	662,323	11.5%	지수옵션 전체	1,183,652	316.0	1,830,830
Put	615,626	171.2	1,168,507	13.7%	PCR(금액기준)	1.18	VKOSPI	14.52%(-0.28%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	447.5(K+3)	0.53	-0.51	65,265	17,958	1,207	11.7	442.5(K+1)
	445.0(K+2)	0.88	-0.70	69,098	21,140	3,276	11.5	440.0(K+0)
	442.5(K+1)	1.42	-0.93	60,989	21,385	2,197	11.4	437.5(K-1)
	440.0(K+0)	2.20	-1.15	48,402	17,917	553	11.2	435.0(K-2)
	437.5(K-1)	3.30	-1.36	17,885	11,965	-67	11.2	432.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	442.5(K+1)	6.95	0.89	853	1,141	-191	13.9	440.0(K+0)
	440.0(K+0)	5.23	0.63	6,695	4,179	-42	13.6	437.5(K-1)
	437.5(K-1)	3.83	0.46	17,635	7,787	971	13.5	435.0(K-2)
	435.0(K-2)	2.73	0.26	53,657	10,155	723	13.5	432.5(K-3)
	432.5(K-3)	1.91	0.14	65,396	11,506	378	13.8	

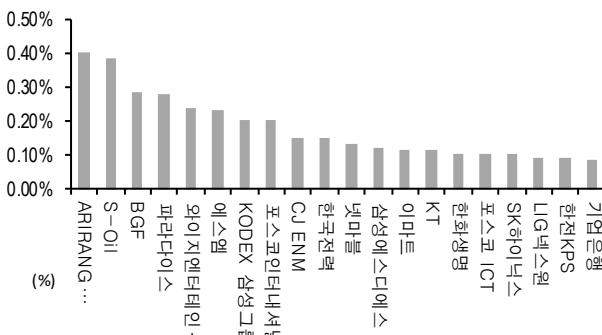
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,665,408	3,003.9	7,326,242	61,989	-92,220	26,600	63,507	4.0	10.0	-15.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
호텔신라	97,300	-0.21	33.6	95.9	39,709	1,045	0.03%	1,315	239	-1,554
삼성 SDI	692,000	1.17	116.3	78.2	32,834	791	0.04%	2,562	171	-2,719
기아	89,500	0.00	107.3	73.7	164,234	-4,662	0.01%	76	535	-611
NAVER	411,500	0.98	164.3	70.3	70,336	1,439	0.04%	2,253	-2,754	477
삼성전자	80,900	-0.86	775.8	63.6	1,329,156	26,757	0.03%	-6,284	24,628	-18,135
삼성전기	176,000	1.15	39.6	63.2	24,283	2,295	0.06%	1,010	1,570	-2,584
SK 하이닉스	125,000	-1.19	174.7	63.0	187,099	6,074	0.10%	-857	5,654	-4,794
카카오	158,500	1.60	382.2	62.3	252,448	-71	0.04%	7,668	-2,618	-5,069
엔씨소프트	824,000	0.49	35.5	53.1	4,623	416	-0.29%	-319	-4	323
LG 전자	160,500	-2.13	72.0	49.7	55,265	123	0.02%	-1,015	-2,546	3,564

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터