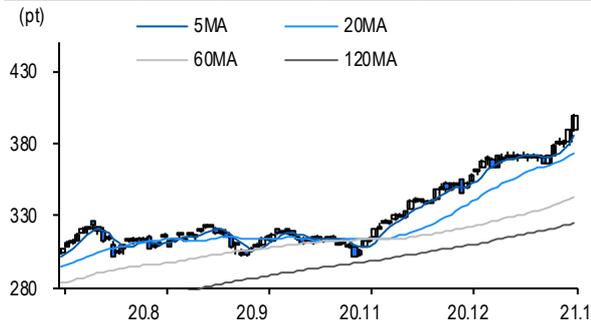


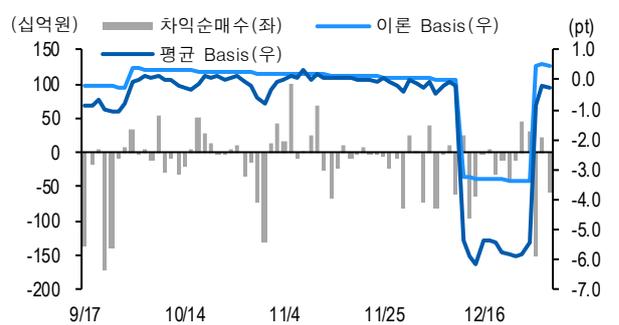


선물옵션시장 지표 2021.15

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	399.88	2.72	10.59	20,604.8	-
선물 3월물	400.60	2.94	11.45	35,222.1	235,774
선물 6월물	399.40	2.77	10.75	17.5	14,064
1월물(mini)	400.56	2.93	11.40	4,984.8	155,652
2월물(mini)	400.56	2.79	10.86	74.0	9,341



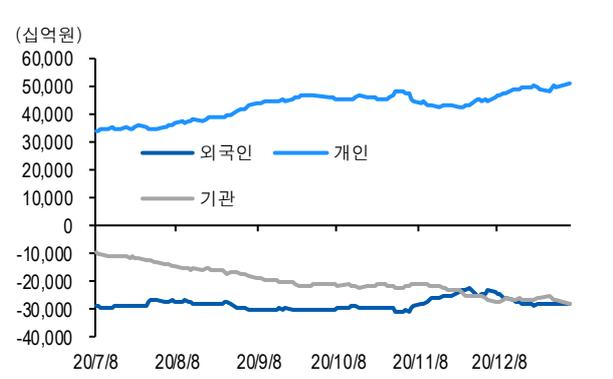
차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.48	-0.24	0.72	-0.18%	
베이스(mini)	0.07	-0.17	0.68	-0.06%	
제1스프레드(SP)	0.05	-0.46	-0.40	-0.13%	
합성선물 베이스(ATM)	0.07	0.62	0.62	0.14%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	89.7	20.4	110.1	1.2	162.9	-553.9	238.2	-11.2	0.7	-49.4
개인	1,031.6	94.0	1,125.6	0.0	-1.0	-103.2	1.2	9.2	1.0	-13.7
기관	-1,189.8	-117.2	-1,306.9	-60.3	-690.7	658.0	-227.7	-0.4	-0.4	59.6
금융투자	-170.5	101.7	-68.9	-71.9	-134.6	187.0	-228.7	-0.2	-0.1	-1.6
투신	-316.8	5.9	-310.9	0.0	-234.2	458.2	0.9	-0.4	-0.3	30.0
은행+보험+기타금융	-189.4	-333.7	-523.0	0.0	-143.9	27.5	0.0	0.2	0.0	-0.6
연기금+국가자재	-323.7	25.8	-297.9	11.6	-102.6	-14.7	0.1	0.0	0.0	31.8
기타법인	68.5	2.8	71.3	0.0	3.2	-1.0	-11.7	2.4	-1.4	3.6

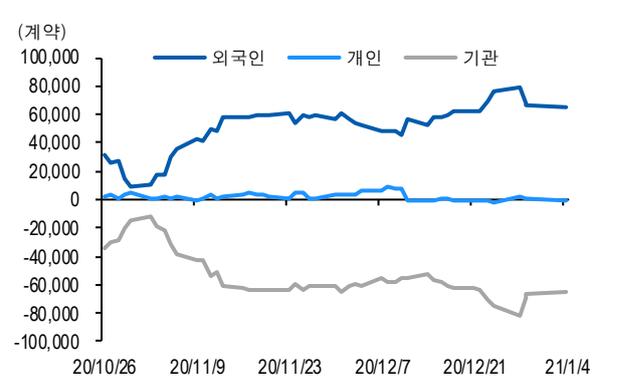
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	미결제약정
Call	1,776,191	940.6	668,894	24.9%	지수옵션 전체	3,421,431	1,352.9	2,219,899
Put	1,645,240	412.3	1,551,005	25.1%	PCR(금액기준)	0.44	VKOSPI	24.81%(+2.72%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	8.10	5.15	65,703	12,782	1,837	24.6	Put	392.5(K+1)	3.40	-4.55	17,871	2,749	2,265	23.5
	395.0(K+2)	9.70	6.00	21,346	13,639	-2,238	25.2		390.0(K+0)	2.75	-3.90	37,717	6,217	4,526	24.0
	392.5(K+1)	11.45	6.82	15,754	9,553	-151	25.9		387.5(K-1)	2.20	-3.24	36,735	6,100	1,566	24.4
	390.0(K+0)	13.25	7.53	13,394	12,998	-1,226	26.3		385.0(K-2)	1.80	-2.61	50,702	7,473	1,587	25.1
	387.5(K-1)	15.30	8.26	5,956	9,558	-912	27.4		382.5(K-3)	1.47	-2.09	58,687	6,010	985	25.8

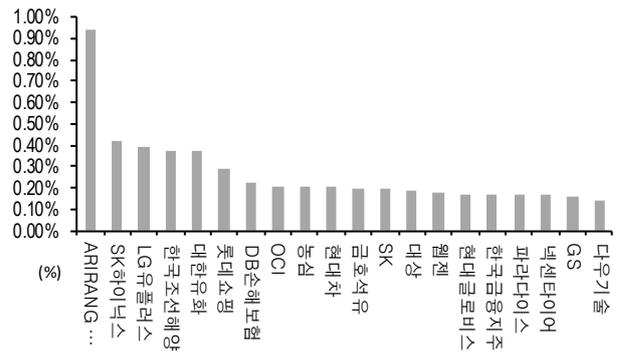
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	7,482,577	7,662.8	6,917,782	58,666	-57,611	17,515	30,692	-49.4	-13.7	59.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	83,100	2.72	2,788.6	87.7	1,328,780	-123,836	0.02%	-49,540	-47,329	97,002	86,664	46,038
현대모비스	288,000	12.50	371.3	71.4	24,177	8,909	0.06%	-5,028	2,224	2,815	-2,707	874
SK 하이닉스	127,000	6.28	630.5	63.8	382,762	38,318	0.42%	-113	-6,304	6,260	-28,458	-10,020
삼성 SDI	671,000	6.68	283.3	61.7	20,526	-4,212	-0.02%	-431	-1,555	2,028	-64	4,358
LG 화학	890,000	7.49	433.8	58.9	21,923	1,277	0.10%	47	-596	493	405	-1,253
한화솔루션	49,350	2.71	118.4	55.7	89,355	10,010	0.05%	1,563	8,805	-9,946	-275	-9,285
기아차	64,400	3.04	185.0	54.2	150,623	35,646	0.13%	-2,369	4,653	-2,277	-23,689	-8,351
카카오	397,000	1.66	176.5	52.7	32,322	-4,716	-0.02%	2,347	-565	-1,829	415	3,192
SK 이노베이션	230,500	20.37	463.9	49.4	78,315	4,883	0.06%	-1,791	-3,469	5,347	-6,870	2,416
현대차	209,000	8.29	556.6	48.0	111,579	15,366	0.20%	3,942	11,601	-15,632	-5,211	-7,794

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터