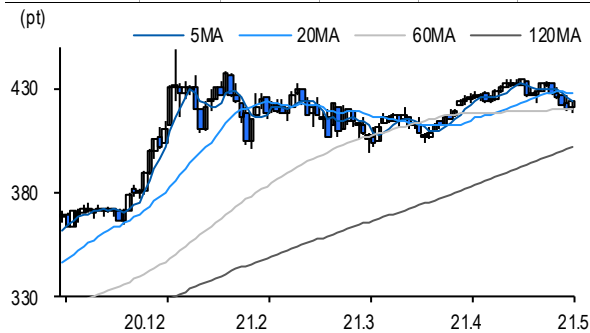


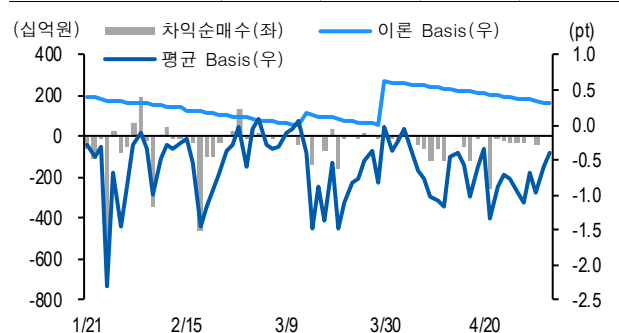
선물옵션시장 지표

2021.5.6

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	423.57	0.76	3.21	10,122.7	-
선물 6월물	423.20	0.82	3.45	25,400.3	232,188
선물 9월물	422.70	0.80	3.35	24.6	4,597
5월물(mini)	423.16	0.78	3.28	2,436.3	56,882
6월물(mini)	423.30	0.84	3.50	8.3	6,162



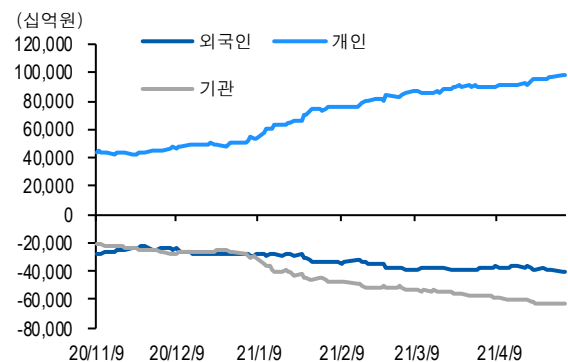
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.31	-0.39	-0.37	-0.17%
베이스(mini)	0.08	-0.32	-0.41	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.45	-0.40	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.08	-0.42	-0.42	-0.12%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-73.4	-53.4	-126.8	0.8	-115.2	368.1	-50.7	2.2	-0.7	98.6
개인	-119.0	-0.6	-119.7	0.0	0.6	-199.8	-74.7	-3.5	1.6	5.1
기관	167.9	56.3	224.2	-0.1	7.4	-128.4	160.1	1.7	-0.3	-105.0
금융투자	71.8	6.5	78.4	-0.1	-11.2	-455.2	158.7	1.7	-0.3	-73.5
투신	77.0	16.9	93.8	0.0	30.1	301.2	1.3	-0.1	-0.2	24.7
은행+보험+기타금융	-11.1	41.6	30.6	0.0	-7.7	26.1	0.0	0.0	0.2	-3.3
연기금+국가자재	32.2	-0.7	31.5	0.0	-23.4	-0.5	0.1	0.0	0.0	-52.9
기타법인	24.6	-2.3	22.3	0.0	1.3	-39.9	-34.7	-0.4	-0.7	1.2

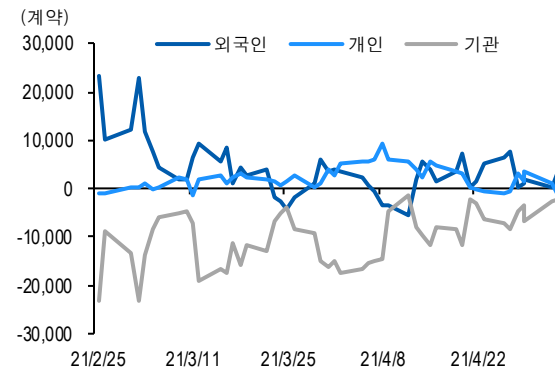
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



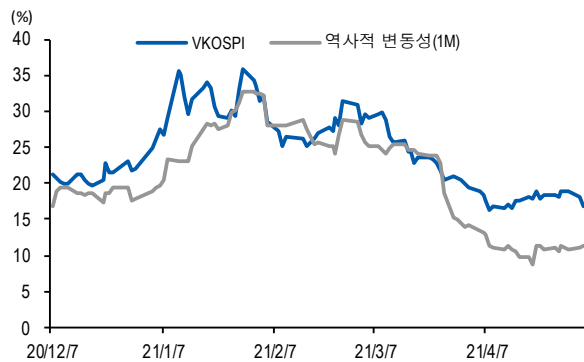
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	797,730	212.3	824,253	12.9%	지수옵션 전체	1,689,591	433.7	2,366,943
Put	891,861	221.4	1,542,690	16.0%	PCR(금액기준)	1.04	VKOSPI	16.89%(-1.20%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	2.03	0.35	92,761	12,019	-4	12.9	Put	422.5(K+1)	3.55	-2.41	6,481	8,729	225	14.7
	425.0(K+2)	2.94	0.54	75,717	14,421	2,862	12.8		420.0(K+0)	2.63	-2.03	25,373	15,610	276	15.1
	422.5(K+1)	4.22	0.88	33,006	7,382	916	12.9		417.5(K-1)	1.89	-1.71	28,046	10,284	717	15.4
	420.0(K+0)	5.78	1.24	19,060	6,588	1,903	13.2		415.0(K-2)	1.33	-1.43	58,488	19,313	430	15.7
	417.5(K-1)	7.55	1.58	6,172	1,764	451	13.3		412.5(K-3)	0.96	-1.17	66,521	12,915	2,624	16.3

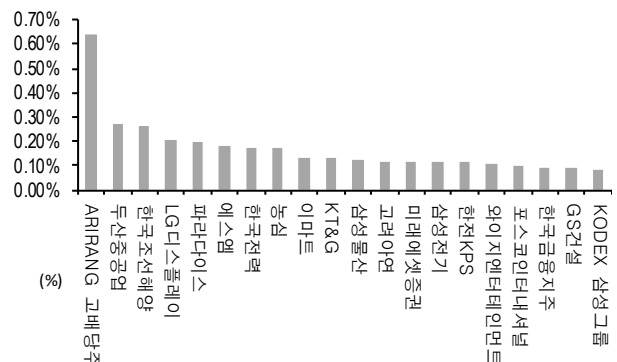
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,682,340	4,482.7	7,486,558	30,391	128,619	-3,740	-125,743	98.6	5.1	-105.0	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	82,600	0.98	1,018.3	100.5	1,333,216	-10,222	0.01%	3,312	10,998	-14,666	-19,411	-3,940
하나금융지주	43,800	-0.57	34.9	91.8	100,621	-3,915	0.03%	1,058	5,594	-6,965	-2,407	-4,458
POSCO	377,000	2.45	153.6	89.3	17,329	1,666	0.02%	139	73	-219	-635	-910
LG 화학	925,000	2.32	223.4	82.5	17,878	-893	-0.07%	324	559	-890	459	-106
LG 디스플레이	24,150	0.00	85.3	81.9	780,360	1,747	0.20%	56,769	736	-57,365	-34,878	-16,412
SK 이노베이션	274,500	7.02	255.6	79.1	38,939	1,617	0.00%	1,288	-3,276	1,832	2,333	-454
삼성 SDI	651,000	2.04	104.8	77.0	25,865	58	0.05%	1,398	-106	-1,295	-214	-1,264
SK 텔레콤	305,500	0.33	115.7	71.8	10,119	280	0.04%	-114	472	-348	160	-175
삼성전기	179,500	1.41	47.1	70.5	23,873	-362	0.11%	2,518	298	-2,809	-1,223	-1,615
SK 하이닉스	132,500	0.76	232.9	70.2	274,821	-3,012	0.01%	392	-764	88	1,314	-170

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터