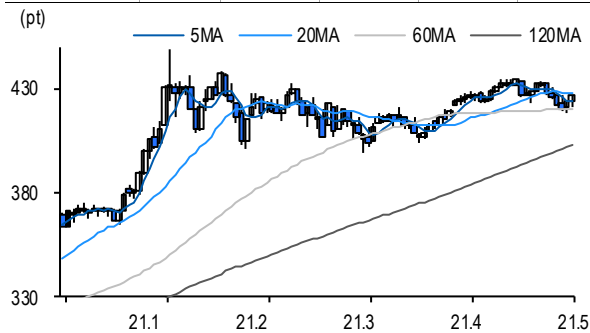


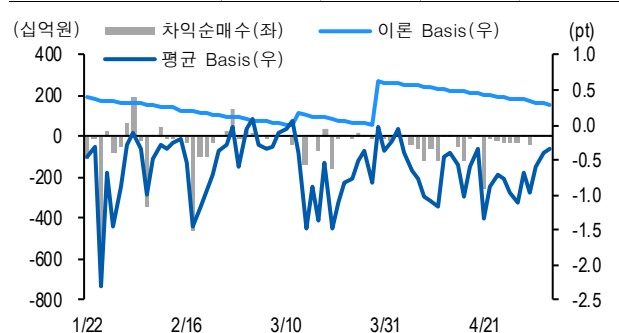
## 선물옵션시장 지표

2021.5.7

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	426.64	0.72	3.07	11,836.2	-
선물 6월물	425.45	0.53	2.25	27,878.8	234,828
선물 9월물	424.75	0.48	2.05	23.4	4,608
5월물(mini)	425.34	0.52	2.18	2,331.9	65,630
6월물(mini)	425.40	0.52	2.10	16.7	6,590



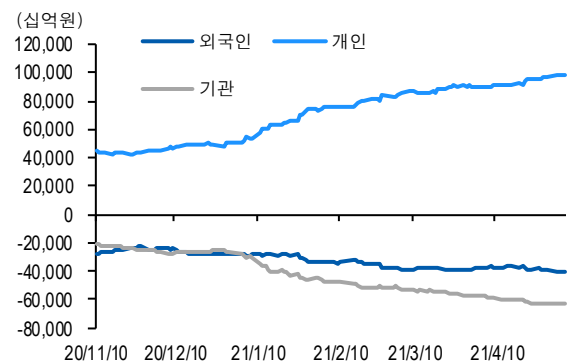
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.30	-0.35	-1.19	-0.15%
베이스(mini)	0.06	-0.36	-1.30	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.47	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.06	-1.28	-1.28	-0.31%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-98.8	-12.6	-111.4	-1.9	18.6	158.2	-193.6	2.6	-0.1	79.4
개인	-89.9	31.4	-58.5	0.0	2.3	233.8	-11.9	1.6	4.0	-8.5
기관	200.8	-21.9	178.9	8.3	6.6	-458.8	210.7	-4.0	-3.6	-71.2
금융투자	193.5	-33.9	159.5	10.5	0.2	-520.0	210.8	-3.2	-3.9	-20.5
투신	19.9	3.2	23.0	0.0	11.9	30.6	0.0	-0.8	0.0	-58.8
은행+보험+기타금융	-10.9	3.4	-7.5	0.0	-2.8	22.9	0.0	0.0	0.3	0.2
연기금+국가자재	-16.3	-0.9	-17.2	-2.2	-32.7	7.7	-0.1	0.0	0.0	7.9
기타법인	-12.1	3.1	-9.1	0.0	1.4	66.8	-5.2	-0.2	-0.3	0.2

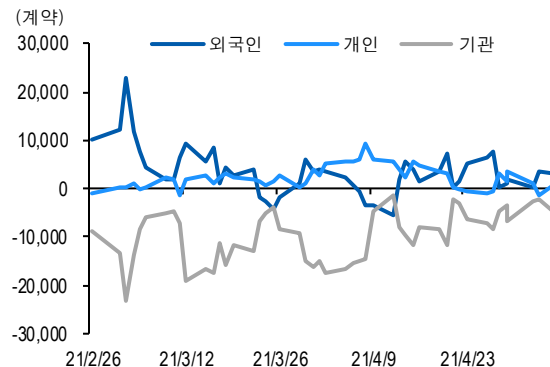
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

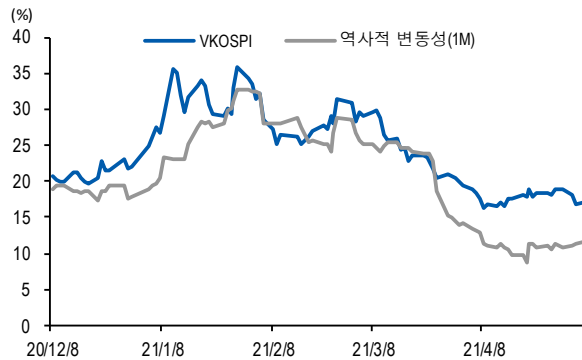
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	871,618	265.7	865,605	11.4%	지수옵션 전체	1,772,034	471.0	2,456,355
Put	900,416	205.3	1,590,750	17.2%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	17.00%(+0.11%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	1.61	0.28	150,228	24,988	2,984	11.7	Put	425.0(K+1)	3.32	-1.49	23,717	11,835	1,294	16.4
	427.5(K+2)	2.48	0.45	92,917	13,353	1,334	11.3		422.5(K+0)	2.34	-1.21	33,734	10,451	1,722	16.4
	425.0(K+1)	3.63	0.69	66,486	16,646	2,225	10.7		420.0(K-1)	1.65	-0.98	63,267	17,072	1,462	16.7
	422.5(K+0)	5.20	0.98	17,243	8,319	937	10.2		417.5(K-2)	1.16	-0.73	71,587	12,082	1,798	17.2
	420.0(K-1)	7.01	1.23	10,819	7,379	791	8.8		415.0(K-3)	0.80	-0.53	87,011	23,060	3,747	17.6

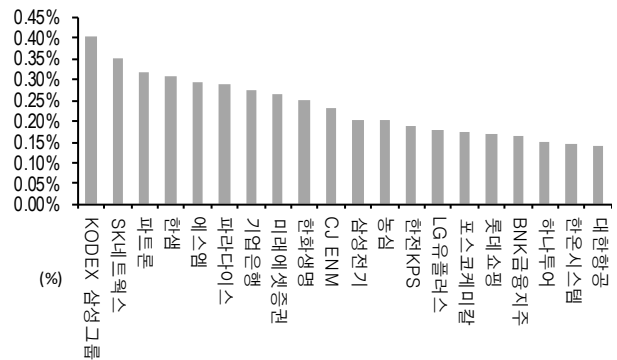
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	5,357,518	4,289.4	7,620,564	134,006	293,994	-87,647	-203,138	79.4	-8.5	-71.2	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 디스플레이	24,200	0.21	76.3	88.2	759,669	-20,691	0.08%	67,627	-917	-66,311	-36,411	-5,337
SK 텔레콤	310,000	1.47	105.7	87.8	10,128	9	0.08%	-322	191	125	-180	766
하나금융지주	46,250	5.59	59.9	84.0	105,247	4,626	0.06%	17,000	-3,614	-12,508	-11,229	-3,239
SK 이노베이션	281,500	2.55	242.6	73.5	49,573	10,634	0.10%	-330	3,950	-3,814	-7,261	-3,544
삼성전자	81,900	-0.85	967.5	70.0	1,320,638	-12,578	-0.07%	-4,122	6,507	-2,635	9,121	10,824
POSCO	394,000	4.51	193.9	69.2	18,312	983	0.01%	1,434	-1,832	382	645	-99
호텔신라	92,700	2.66	80.1	65.5	74,688	7,695	0.05%	1,922	5,614	-9,073	-5,269	-3,562
LG 화학	939,000	1.51	188.7	61.9	15,436	-2,442	-0.22%	761	-1,032	336	2,155	432
롯데케미칼	304,500	4.64	68.0	61.2	18,334	3,861	0.13%	1,629	3,043	-4,713	-1,322	-3,759
한국금융지주	109,000	1.87	23.4	56.1	74,305	-3,761	0.04%	325	-1,453	1,129	1,072	3,114

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터