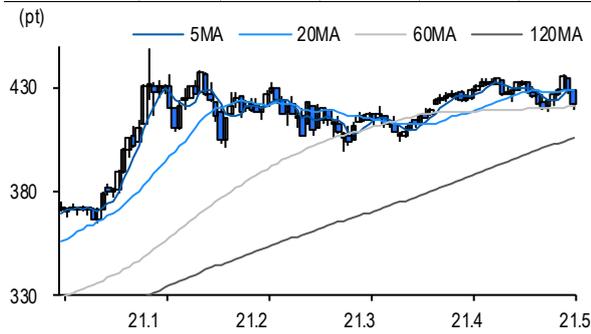


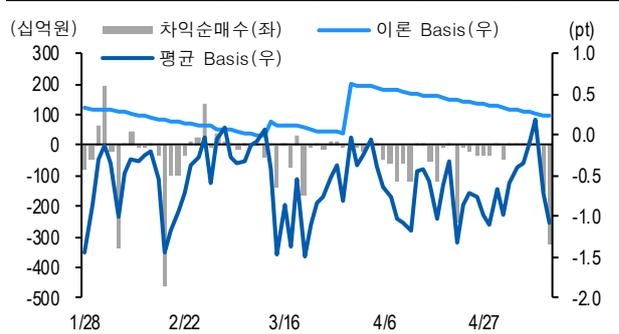
선물옵션시장 지표

2021.5.13

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	421.86	-1.61	-6.91	15,905.4	-
선물 6월물	420.50	-1.72	-7.35	41,753.5	244,080
선물 9월물	420.25	-1.70	-7.25	40.4	5,310
5월물(mini)	421.16	-1.65	-7.08	3,112.2	62,117
6월물(mini)	420.62	-1.69	-7.26	88.6	10,619

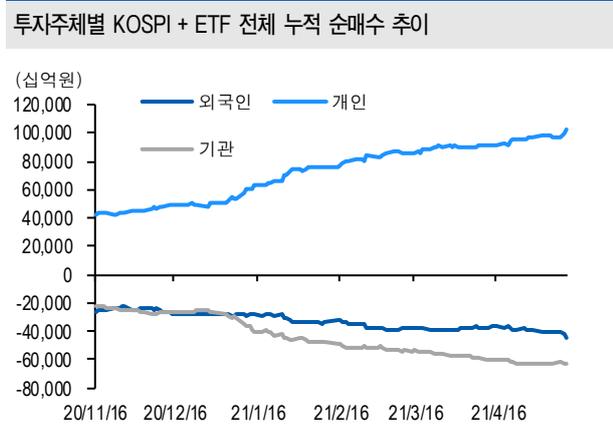


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.23	-1.07	-1.36	-0.31%
베이스스(mini)	0.01	-0.47	-0.70	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.08	-0.40	-0.40	-0.11%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.64	-0.64	-0.15%

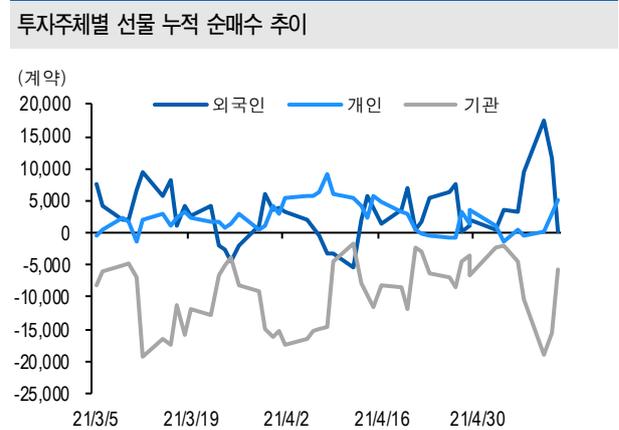


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-2,699.8	30.3	-2,669.4	-294.4	-1,588.2	-1,256.5	59.3	-2.4	-4.8	70.9
개인	2,985.0	-15.1	2,969.9	0.0	-12.7	166.1	43.3	-1.0	5.8	-140.0
기관	-253.5	-20.1	-273.6	-31.7	-67.9	1,159.5	-109.2	3.6	-3.4	77.4
금융투자	-209.4	-59.0	-268.4	-29.5	-29.8	1,298.0	-112.4	4.1	-3.7	98.8
투신	-79.5	-26.3	-105.8	0.0	-45.8	-177.5	0.1	-0.6	0.3	-10.6
은행+보험+기타금융	-49.9	61.8	11.8	-4.1	-17.4	31.4	3.3	0.0	0.0	1.2
연기금+국가지자체	95.7	5.3	101.1	1.9	34.5	7.5	-0.2	0.0	0.0	-12.0
기타법인	-31.7	4.9	-26.8	0.0	-1.2	-69.0	6.6	-0.1	2.4	-8.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,073,735	392.5	1,038,077	18.5%	지수옵션 전체	5,091,644	1,179.0	2,836,028
Put	3,017,909	786.5	1,797,951	22.0%	PCR(금액기준)	2.00	VKOSPI	22.17%(+2.17%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	0.03	-0.24	160,160	23,477	1,678	21.9	Put	432.5(K+1)	10.95	5.62	5,943	13,363	-944	25.0
	435.0(K+2)	0.06	-0.49	241,926	28,162	-1,849	20.9		430.0(K+0)	8.95	5.28	19,284	18,474	-1,267	27.7
	432.5(K+1)	0.09	-0.99	269,853	30,865	8,793	18.9		427.5(K-1)	6.67	4.30	62,420	17,196	-1,967	24.5
	430.0(K+0)	0.17	-1.72	347,244	39,628	15,197	17.4		425.0(K-2)	4.64	3.14	135,820	24,339	-3,740	22.4
	427.5(K-1)	0.39	-2.72	270,619	27,806	11,083	16.8		422.5(K-3)	3.03	2.10	190,456	17,810	-3,135	21.7

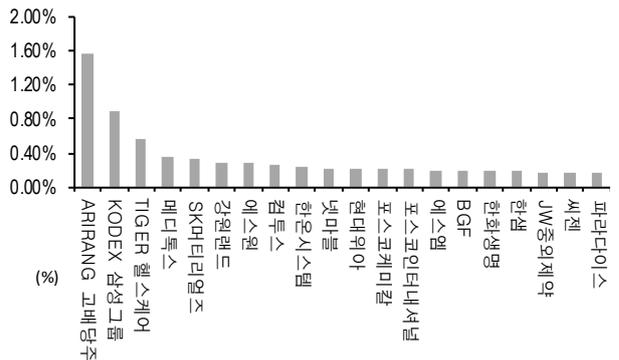
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	6,767,798	5,853.3	7,818,152	-81,036	15,606	-120,692	110,405	70.9	-140.0	77.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	45,700	-2.45	36.1	77.4	61,295	-14,209	0.05%	-7,005	1,025	4,965	4,746	166
호텔신라	93,300	-1.06	55.1	75.3	48,534	-9,965	0.04%	2,749	-6,043	3,404	673	2,765
POSCO	399,000	-2.56	179.6	71.6	11,003	-1,727	-0.03%	-982	695	284	-1,329	-647
SK 이노베이션	266,500	-1.11	124.4	68.1	35,811	-164	0.15%	2,303	-42	-2,205	-456	-4,686
LG 디스플레이	22,600	-3.00	83.7	67.4	534,143	-63,722	0.14%	63,383	-373	-61,700	-198	-23,683
SK 텔레콤	312,000	-2.35	82.1	63.6	4,690	-1,495	0.06%	94	424	-127	822	528
현대차	227,000	-0.22	227.4	61.2	65,854	-1,042	0.12%	1,103	-2,739	1,433	-6,745	-953
엔씨소프트	852,000	0.12	41.8	59.7	2,748	-323	0.12%	676	-75	-581	-101	-549
S-Oil	97,300	-1.02	40.7	51.1	18,640	-5,349	0.04%	1,591	-2,667	1,076	1,555	-400
SK 하이닉스	118,500	-3.66	495.2	50.2	223,556	-2,011	-0.15%	9,762	-11,677	2,431	-592	2,455

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터