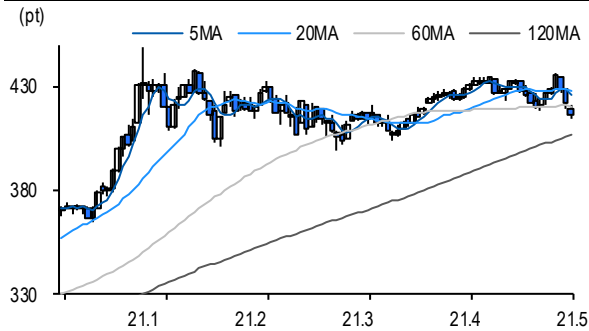


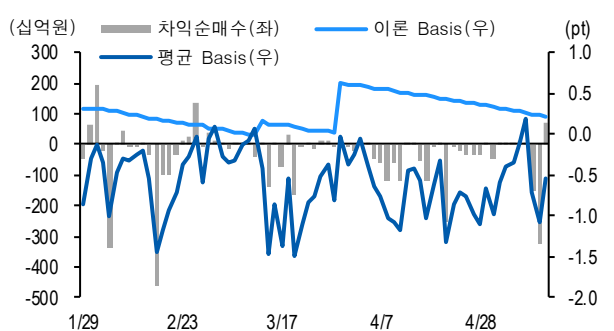
선물옵션시장 지표

2021.5.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	416.07	-1.37	-5.79	16,201.9	-
선물 6월물	415.10	-1.28	-5.40	37,423.4	241,090
선물 9월물	414.75	-1.31	-5.50	42.6	5,635
5월물(mini)	416.24	-1.17	-4.92	1,632.8	0
6월물(mini)	415.18	-1.27	-5.44	1,312.1	22,525



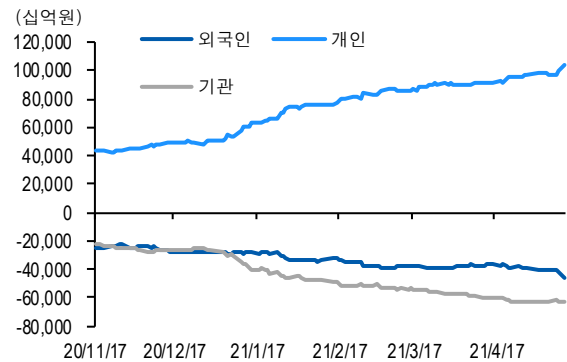
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.21	-0.54	-0.97	-0.18%
베이스스(mini)	0.00	-0.15	0.17	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.45	-0.45	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	0.13	0.13	0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,429.8	-24.1	-1,453.9	0.0	-871.5	675.3	-18.1	3.1	28.0	20.1
개인	1,441.4	17.8	1,459.2	0.0	-4.4	-140.7	6.6	-1.6	-30.5	-46.4
기관	4.5	5.3	9.7	74.4	246.6	-500.6	5.8	-0.6	1.9	34.6
금융투자	72.2	-58.9	13.4	64.5	163.5	-705.9	1.8	5.4	-6.3	105.1
투신	53.3	18.0	71.3	0.0	8.0	146.1	0.1	-3.0	8.1	-66.0
은행+보험+기타금융	26.1	47.1	73.3	0.0	20.4	33.3	3.9	-2.9	0.0	1.0
연기금+국가자재	-96.6	0.3	-96.3	10.0	45.6	25.9	0.0	0.0	0.1	-5.4
기타법인	-16.0	1.0	-15.0	0.0	1.4	-33.9	5.7	-0.9	0.6	-8.3

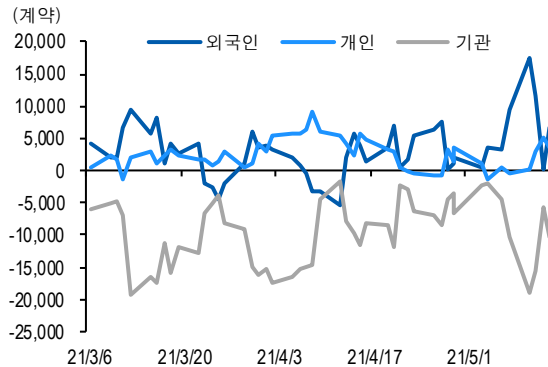
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



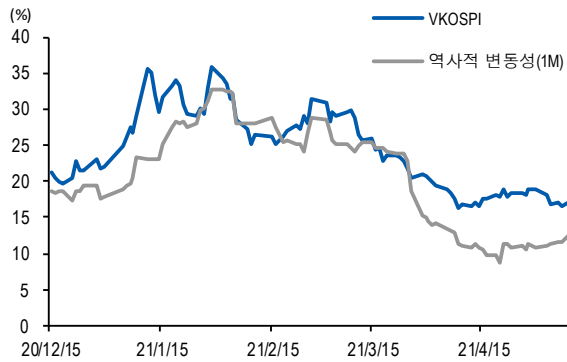
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,558,402	392.1	500,834	12.3%	지수옵션 전체	5,872,281	977.5	1,439,386
Put	3,313,879	585.4	938,552	6.5%	PCR(금액기준)	1.49	VKOSPI	21.90%(-0.27%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	0.01	-0.16	87,033	0	-39,628	24.8	Put	425.0(K+1)	8.74	4.10	7,024	0	-24,339	0.3
	427.5(K+2)	0.01	-0.38	149,723	0	-27,806	20.9		422.5(K+0)	6.31	3.28	46,258	0	-17,810	18.4
	425.0(K+1)	0.01	-0.87	355,220	0	-23,443	16.9		420.0(K-1)	3.72	1.90	196,252	0	-25,331	8.6
	422.5(K+0)	0.01	-1.73	597,872	0	-12,476	12.7		417.5(K-2)	1.36	0.28	408,009	0	-20,147	3.3
	420.0(K-1)	0.01	-3.07	597,334	0	-9,157	8.3		415.0(K-3)	0.10	-0.51	693,975	0	-30,478	5.1

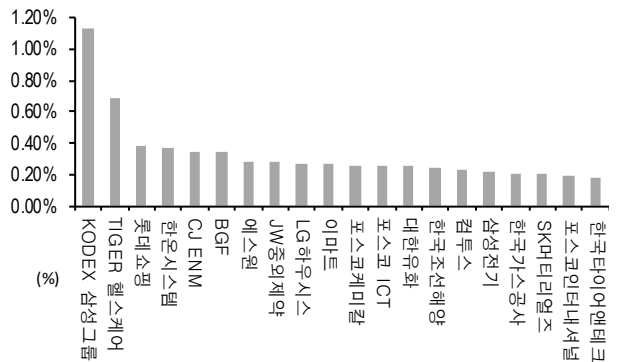
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	8,496,758	6,519.5	5,750,619	-2,067,533	51,520	-105,087	64,427	20.1	-46.4	34.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	191,000	0.26	19.7	46.7	0	-13,261	0.17%	-899	-1,135	2,226	275	-415
한국금융지주	104,000	-0.95	34.4	46.2	0	-53,098	-0.37%	2,119	583	-2,702	5,650	622
GS 건설	43,550	0.00	16.3	41.4	0	-29,777	-0.06%	-2,028	-4,260	6,273	7,476	54
POSCO	384,500	-3.63	120.7	41.0	0	-11,003	-0.09%	-327	905	-427	1,016	2,366
호텔신라	93,800	0.54	44.7	38.2	0	-48,534	-0.05%	2,085	-8,670	7,650	13,874	-407
두산밥캣	49,150	-3.63	9.9	38.0	0	-19,297	-0.29%	636	1,733	-2,363	4,972	1,213
엔씨소프트	842,000	-1.17	33.1	37.1	0	-2,748	0.10%	-4	-116	113	98	-444
SK 이노베이션	260,500	-2.25	114.1	36.8	0	-35,811	-0.04%	1,008	1,855	-2,779	2,665	2,428
SK 하이닉스	117,000	-1.27	242.7	34.7	0	-223,556	0.01%	-5,612	9,739	-4,745	2,843	-3,685
하나금융지주	47,050	2.95	29.6	34.6	0	-61,295	-0.06%	1,011	-2,954	2,333	7,169	250

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터