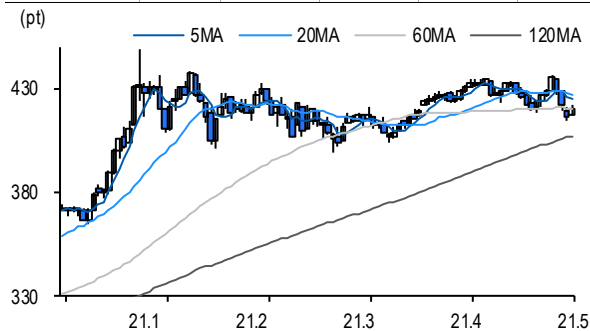


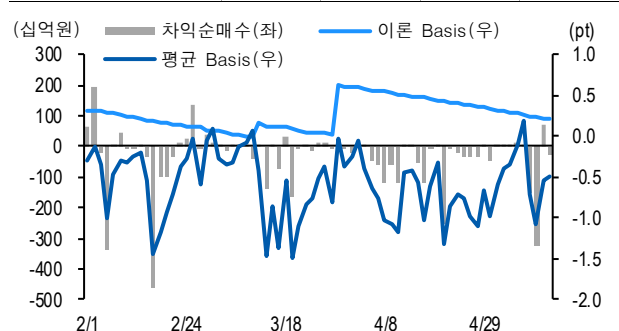
선물옵션시장 지표

2021.5.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	420.17	0.99	4.10	10,375.1	-
선물 6월물	419.85	1.14	4.75	25,496.2	236,311
선물 9월물	419.35	1.11	4.60	41.0	5,667
6월물(mini)	419.90	1.16	4.72	1,807.0	24,018
7월물(mini)	419.02	1.11	4.62	3.1	207



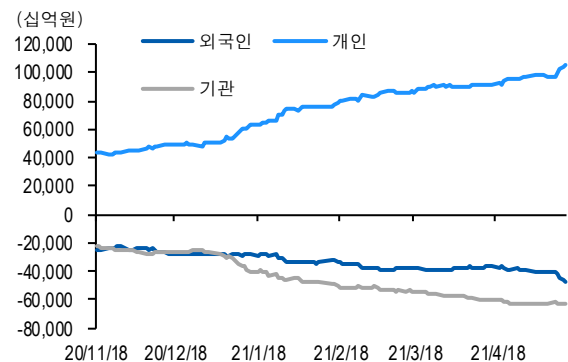
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.21	-0.50	-0.32	-0.17%
베이스(mini)	0.21	-0.50	-0.27	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.45	-0.45	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	0.21	-0.26	-0.26	-0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-419.3	-36.1	-455.4	-15.3	-427.1	150.3	37.1	2.3	-0.5	16.9
개인	385.3	-36.4	348.9	0.0	1.0	-218.8	-46.1	-1.9	-1.5	67.5
기관	38.7	71.8	110.5	-9.2	17.0	102.2	9.9	0.0	2.1	-84.1
금융투자	-82.4	14.0	-68.4	-13.4	-22.0	-246.4	8.4	0.8	2.6	-13.5
투신	31.3	9.2	40.6	0.0	12.7	452.2	1.5	-0.8	-0.6	26.5
은행+보험+기타금융	7.1	41.2	48.4	0.0	11.9	-105.4	0.0	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가지자체	93.2	8.6	101.8	4.2	4.1	1.8	0.0	0.0	0.0	-96.9
기타법인	-4.8	0.7	-4.1	0.0	0.5	-33.8	-0.8	-0.4	-0.1	-0.2

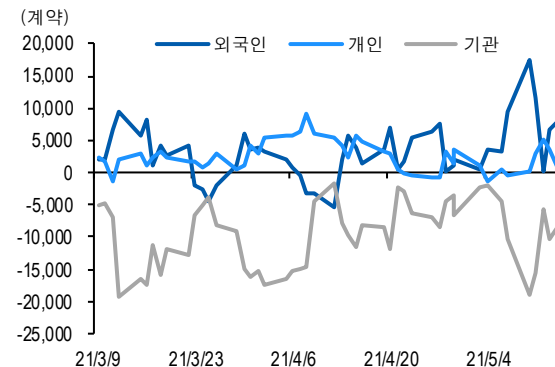
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	489,835	200.0	550,535	16.2%	지수옵션 전체	1,106,653	402.6	1,552,965
Put	616,818	202.7	1,002,430	18.8%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	19.32%(-2.58%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	6.41	1.18	4,523	2,181	1,206	15.9	Put	417.5(K+1)	6.81	-3.06	4,701	2,854	954	17.7
	420.0(K+2)	7.75	1.45	7,764	9,699	757	16.3		415.0(K+0)	5.89	-2.79	6,925	7,209	1,266	18.0
	417.5(K+1)	9.22	1.68	3,931	2,310	684	16.6		412.5(K-1)	5.12	-2.58	3,002	3,273	385	18.5
	415.0(K+0)	10.80	1.94	1,746	2,185	352	16.9		410.0(K-2)	4.46	-2.35	8,706	10,758	433	18.9
	412.5(K-1)	12.50	1.35	158	102	80	17.3		407.5(K-3)	3.86	-2.17	9,221	3,267	437	19.4

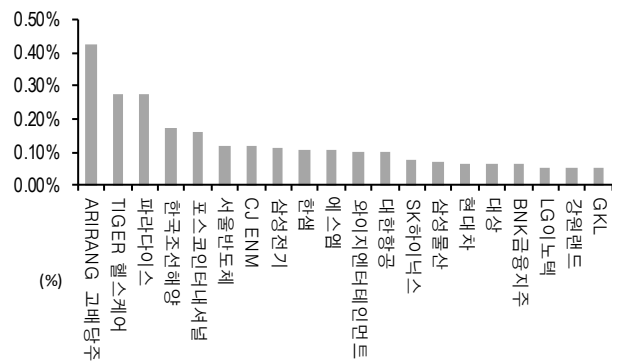
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,097,328	3,440.0	5,755,521	4,902	-83,792	164,710	-78,525	16.9	67.5	-84.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	92,500	-1.49	68.9	109.8	58,573	2,729	0.00%	-1,152	3,817	-1,676	192	-1,868
SK 텔레콤	317,000	1.44	99.1	97.3	7,534	142	-0.14%	-1,046	-576	895	442	520
POSCO	380,000	-1.04	196.0	91.1	13,441	1,267	-0.10%	1,266	345	-1,714	-236	-1,438
하나금융지주	46,000	-1.92	36.3	79.4	162,743	2,388	0.00%	-2,539	3,160	-1,163	2,694	-3,722
현대차	230,000	0.22	231.6	74.2	101,395	11,244	0.07%	-1,089	7,504	-6,461	-1,192	-7,513
SK 이노베이션	269,500	4.05	162.9	69.1	29,565	1,549	0.03%	529	918	-1,457	-1,232	-1,210
S-Oil	96,300	0.73	35.7	69.1	14,609	-613	-0.04%	-626	408	218	-524	-77
삼성생명	85,000	-1.73	34.1	66.9	26,949	-5,416	-0.11%	-4,274	-1,111	4,778	3,820	4,746
삼성전자	79,900	1.78	875.2	66.9	1,259,082	10,163	-0.20%	-6,835	303	13,192	3,287	-199
기아	83,000	1.59	141.5	66.2	85,067	16,450	0.02%	-3,580	11,471	-7,911	238	-11,800

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터