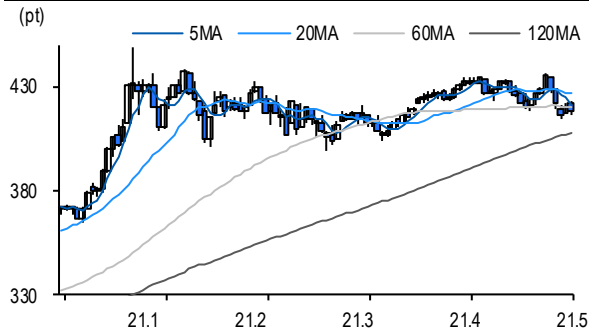


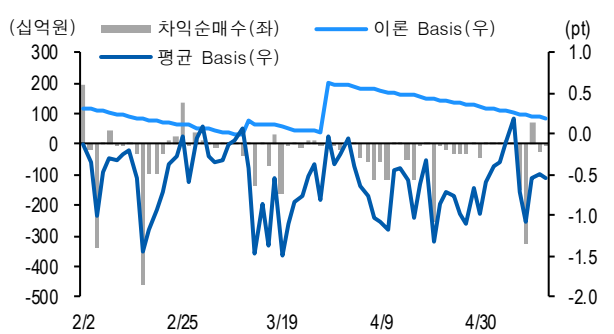
선물옵션시장 지표

2021.5.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	418.27	-0.45	-1.90	9,708.4	-
선물 6월물	418.10	-0.42	-1.75	29,427.2	236,451
선물 9월물	417.80	-0.37	-1.55	56.9	5,744
6월물(mini)	418.18	-0.40	-1.72	1,924.6	24,139
7월물(mini)	417.10	-0.46	-1.92	2.9	271



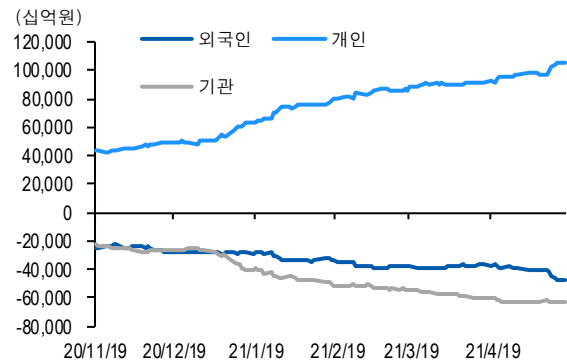
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.18	-0.53	-0.17	-0.17%
베이스스(mini)	0.18	-0.53	-0.09	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.47	-0.45	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.18	-0.16	-0.16	-0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-599.8	23.5	-576.2	0.7	-253.1	-384.7	-26.6	-2.8	-1.4	-53.6
개인	719.8	-21.2	698.7	0.0	-3.7	81.5	31.1	0.9	0.2	5.8
기관	-143.8	-5.6	-149.5	-2.4	16.0	289.9	-13.4	2.1	1.5	49.7
금융투자	-89.3	10.3	-79.0	-4.1	-10.8	355.1	-12.8	2.1	1.6	76.0
투신	-10.6	-15.7	-26.3	0.0	-6.2	-52.9	-0.5	0.0	-0.2	-11.6
은행+보험+기타금융	-38.2	13.3	-24.8	0.0	7.3	-13.2	0.1	0.0	0.0	0.5
연기금+국가자재	6.4	-6.6	-0.3	1.7	7.5	0.9	-0.1	0.0	0.0	-15.2
기타법인	23.8	3.3	27.0	0.0	-3.9	13.3	8.9	-0.3	-0.3	-2.0

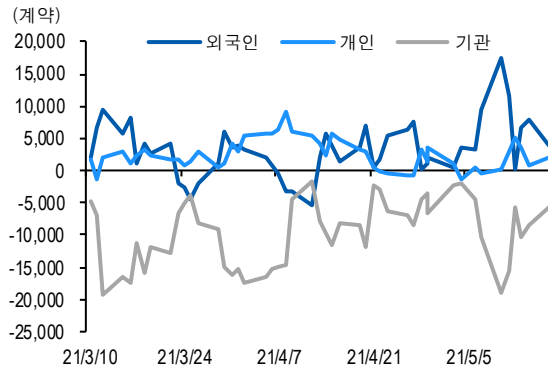
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	578,674	199.4	590,942	15.8%	지수옵션 전체	1,350,458	473.6	1,667,744
Put	771,784	274.2	1,076,802	17.9%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	19.29%(-0.03%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	3.37	-0.95	14,598	4,234	732	15.8	Put	422.5(K+1)	9.55	0.51	1,592	1,746	231	16.8
	425.0(K+2)	4.22	-1.08	17,156	8,013	1,213	15.9		420.0(K+0)	8.30	0.44	5,181	7,452	1,031	17.2
	422.5(K+1)	5.24	-1.17	6,216	3,254	1,073	16.1		417.5(K-1)	7.12	0.31	5,384	3,310	456	17.4
	420.0(K+0)	6.41	-1.34	6,645	10,337	638	16.3		415.0(K-2)	6.19	0.30	8,527	7,622	413	17.9
	417.5(K-1)	7.76	-1.46	1,376	2,547	237	16.7		412.5(K-3)	5.31	0.19	4,505	3,501	228	18.3

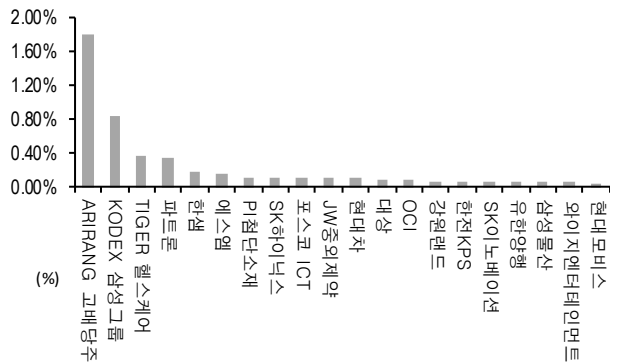
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,843,183	3,793.2	5,738,063	-17,458	-49,368	58,145	-9,081	-53.6	5.8	49.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 텔레콤	307,000	-3.15	91.9	106.0	9,720	2,186	0.03%	-67	1,758	-1,691	387	-2,674
호텔신라	95,500	3.24	96.4	96.6	55,808	-2,765	-0.06%	-519	-3,133	3,453	-350	3,727
하나금융지주	46,250	0.54	39.3	95.2	164,085	1,342	-0.04%	-3,600	-475	3,925	4,933	-968
LG 화학	858,000	0.82	100.3	93.0	14,658	377	-0.35%	-493	-542	1,006	909	120
S-Oil	97,800	1.56	56.4	90.9	18,808	4,199	-0.04%	4,329	-2,854	-1,475	-987	-600
삼성 SDI	623,000	-0.64	127.9	79.6	23,650	-28	0.00%	-823	587	99	-126	759
삼성전자	79,700	-0.25	1,108.3	79.2	1,258,237	-845	-0.23%	-9,525	-2,587	13,063	35,065	-17,550
POSCO	366,500	-3.55	189.1	78.7	14,082	641	-0.05%	-1,101	1,776	-741	190	-981
기아	81,500	-1.81	101.6	71.7	89,256	4,189	0.04%	-1,959	684	1,269	-7,404	6,012
현대차	226,500	-1.52	129.4	70.0	102,836	1,441	0.10%	-2,132	706	1,426	-554	734

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터