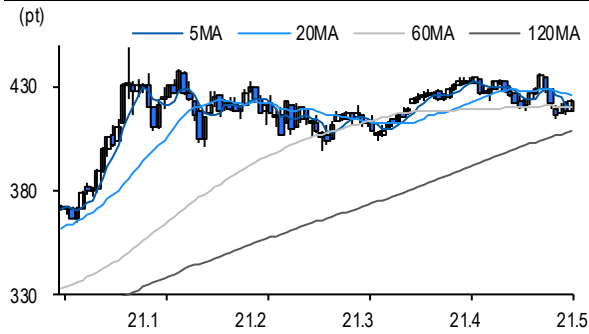


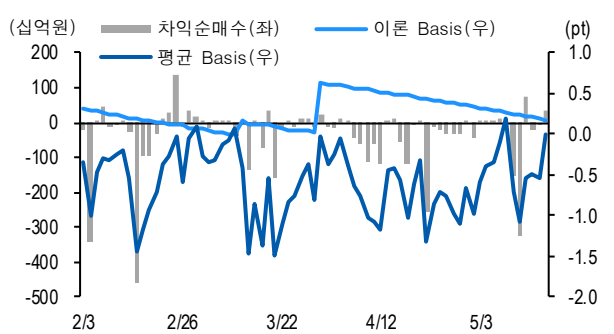
선물옵션시장 지표

2021.5.19

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	423.09	1.15	4.82	8,942.1	-
선물 6월물	422.90	1.15	4.80	21,976.7	235,514
선물 9월물	422.45	1.11	4.65	52.1	5,732
6월물(mini)	422.96	1.16	4.78	1,617.1	21,835
7월물(mini)	422.50	1.29	5.40	2.5	377



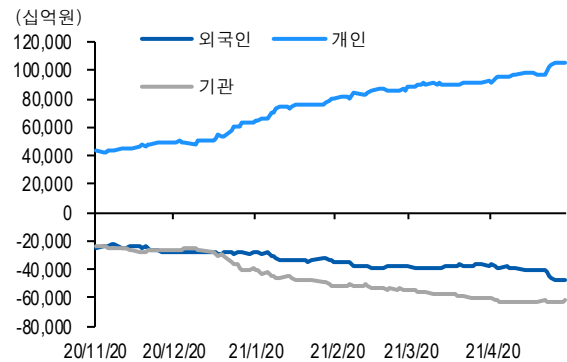
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.18	0.00	-0.19	-0.04%
베이스스(mini)	0.18	0.00	-0.13	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.49	-0.50	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.18	-0.17	-0.17	-0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-347.5	-37.1	-384.6	3.7	-332.7	261.9	62.7	3.2	1.5	79.7
개인	-639.5	-37.0	-676.5	0.0	-1.9	48.2	-43.3	-1.0	0.6	-7.9
기관	974.0	70.8	1,044.7	30.7	24.2	-274.7	-9.8	-1.5	-1.7	-70.8
금융투자	963.4	36.4	999.7	10.2	27.0	-588.0	-10.3	-1.4	-1.6	-119.0
투신	20.9	22.9	43.8	6.3	-4.4	316.8	0.7	0.0	-0.1	82.9
은행+보험+기타금융	-8.7	3.6	-5.1	0.0	1.0	6.0	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가자재	22.0	5.2	27.2	12.2	6.8	-9.6	-0.1	0.0	0.0	-34.8
기타법인	13.0	3.3	16.4	0.0	-0.3	-35.4	-9.6	-0.8	-0.4	-1.0

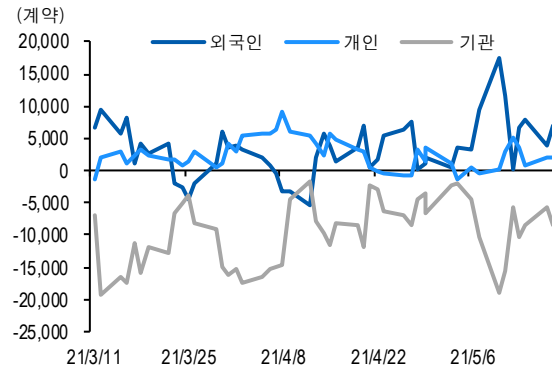
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	541,049	222.3	607,920	15.5%	지수옵션 전체	1,030,317	363.7	1,752,886
Put	489,268	141.4	1,144,966	18.0%	PCR(금액기준)	0.64	VKOSPI	18.23%(-1.06%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	5.86	1.64	12,347	8,558	545	15.4	Put	420.0(K+1)	5.73	-2.57	5,941	8,752	1,300	16.8
	422.5(K+2)	7.16	1.92	4,095	3,492	238	15.6		417.5(K+0)	4.83	-2.29	3,678	3,532	222	17.1
	420.0(K+1)	8.61	2.20	3,981	10,324	-13	15.9		415.0(K-1)	4.10	-2.09	6,088	8,144	522	17.6
	417.5(K+0)	10.25	2.49	1,563	2,822	275	16.3		412.5(K-2)	3.46	-1.85	9,070	4,081	580	18.0
	415.0(K-1)	12.00	2.60	700	2,300	92	16.6		410.0(K-3)	2.93	-1.59	17,044	11,760	559	18.4

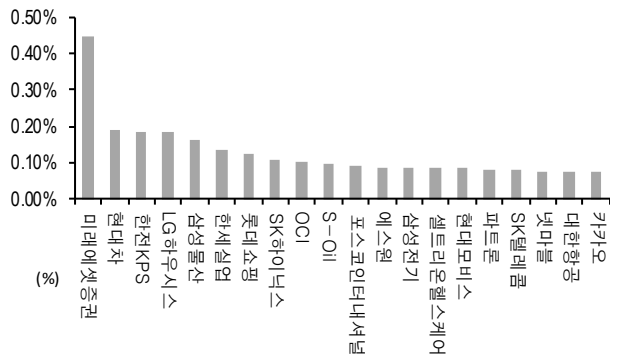
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,960,814	3,386.3	5,874,466	136,403	98,713	3,168	-102,565	79.7	-7.9	-70.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
POSCO	385,000	5.05	212.3	94.8	15,005	923	-0.04%	1,311	-2,362	1,119	-3,720	1,658
하나금융지주	47,050	1.73	45.9	85.9	173,408	9,323	0.01%	-2,717	-4,200	7,352	-4,072	-1,382
SK 텔레콤	307,000	0.00	74.6	84.8	10,366	646	0.08%	2,024	213	-1,510	8	-1,479
호텔신라	93,800	-1.78	48.0	82.6	56,917	1,109	-0.01%	-3,460	3,446	45	136	-406
삼성전자	79,800	0.13	1,096.2	79.5	1,274,372	16,135	-0.05%	32,094	12,826	-46,071	-27,199	-12,350
삼성 SDI	633,000	1.61	78.4	68.3	24,036	386	0.05%	955	216	-1,171	-131	-1,040
현대차	232,000	2.43	156.4	65.7	106,446	3,610	0.19%	4,928	-3,405	-1,535	-4,671	-969
현대모비스	279,000	0.90	55.7	62.8	8,577	1,203	0.08%	-233	198	43	-820	-1,252
신한지주	41,350	0.73	36.1	62.4	62,102	-4,855	0.00%	299	-680	412	2,136	1,863
SK 이노베이션	278,000	1.28	117.0	60.6	33,246	557	0.03%	-801	-901	1,670	-415	947

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터