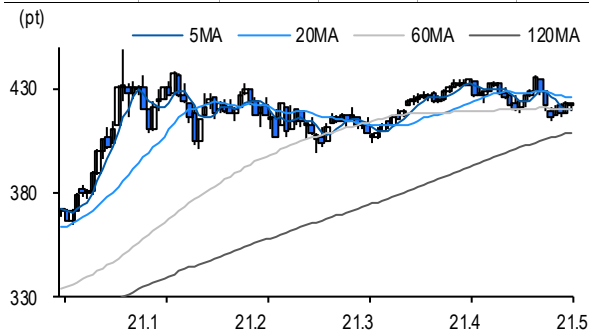


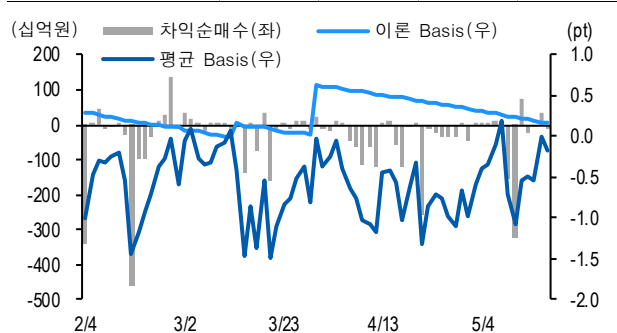
선물옵션시장 지표

2021.5.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	421.68	-0.33	-1.41	9,291.8	-
선물 6월물	421.40	-0.35	-1.50	25,730.8	232,458
선물 9월물	421.20	-0.30	-1.25	51.6	5,731
6월물(mini)	421.54	-0.32	-1.42	1,740.0	23,118
7월물(mini)	420.90	-0.38	-1.60	2.9	395



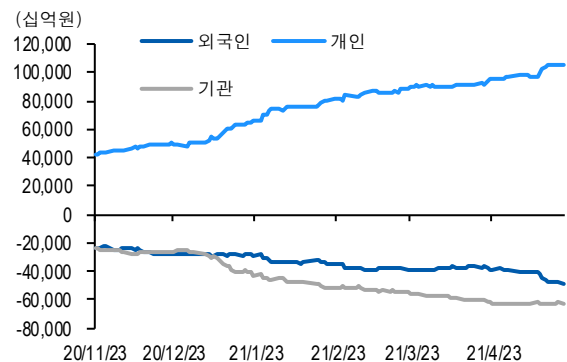
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.16	-0.17	-0.28	-0.08%
베이스(mini)	0.16	-0.17	-0.14	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.48	-0.50	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.16	-0.23	-0.23	-0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-651.7	32.0	-619.7	0.0	-506.8	24.5	8.2	1.4	-1.4	-44.7
개인	858.5	17.6	876.2	0.0	-1.0	20.9	-3.4	-0.1	0.3	59.0
기관	-201.1	-53.0	-254.0	-8.7	32.3	-75.9	-5.1	-0.8	1.3	-18.6
금융투자	-92.7	-57.6	-150.2	-2.5	26.3	140.7	-6.3	-0.4	0.9	-40.3
투신	-13.4	0.6	-12.7	0.0	-7.1	-228.4	1.3	0.0	0.0	21.0
은행+보험+기타금융	-31.6	3.3	-28.4	0.0	-0.7	6.1	0.0	-0.5	0.4	-0.6
연기금+국가자재	-37.3	0.6	-36.7	-6.3	-2.0	5.7	-0.2	0.0	0.0	1.2
기타법인	-5.7	3.4	-2.4	0.0	-0.4	30.5	0.3	-0.4	-0.2	4.2

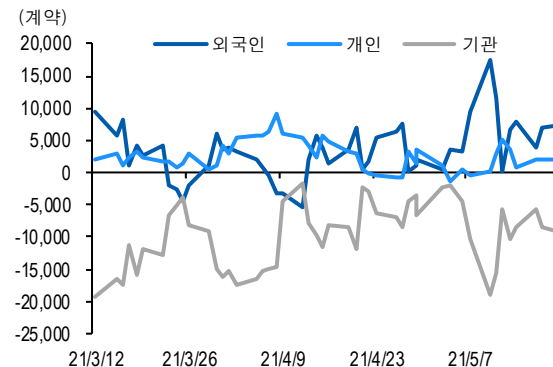
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 싹액원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	545,561		205.1		624,866		15.8%		지수옵션 전체	1,182,957		416.0		1,813,285	
Put	637,396		210.9		1,188,419		18.1%			PCR(금액기준)	1.03		VKOSPI		19.12%(+0.89%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
	430.0(K+3)	3.29	-0.49	32,006	13,652	1,064	15.8		425.0(K+1)	8.77	0.79	2,482	6,214	113	17.1
	427.5(K+2)	4.18	-0.61	10,225	6,154	847	15.9		422.5(K+0)	7.50	0.74	3,783	2,455	201	17.3
	425.0(K+1)	5.24	-0.62	7,118	9,125	567	16.2		420.0(K-1)	6.39	0.66	7,176	9,027	275	17.7
	422.5(K+0)	6.45	-0.71	6,382	4,443	951	16.4		417.5(K-2)	5.44	0.61	3,776	3,595	63	18.0
	420.0(K-1)	7.82	-0.79	5,319	10,560	236	16.6		415.0(K-3)	4.64	0.54	6,513	8,328	184	18.5

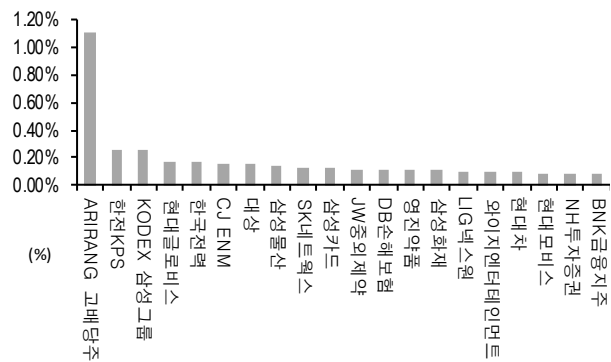
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,667,487	3,101.7	6,021,129	146,663	-26,647	65,433	-44,591	-44.7	59.0	-18.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	93,400	-0.43	55.1	118.2	56,014	-903	-0.06%	2,906	-132	-2,724	1,380	-1,234
SK 텔레콤	306,000	-0.33	61.2	85.0	11,242	876	0.05%	32	1,133	-1,165	-276	-923
롯데케미칼	288,500	1.58	37.9	74.1	9,502	572	-0.05%	298	353	-985	-215	-770
현대모비스	278,000	-0.36	53.4	73.5	8,570	-7	0.09%	-839	-676	1,515	302	169
하나금융지주	46,050	-2.13	40.3	70.8	174,508	1,100	0.01%	-1,613	2,370	-909	-1,288	475
NAVER	351,000	0.57	119.8	64.4	46,202	3,432	-0.03%	-253	3,784	-3,751	-3,609	-19
SK 하이닉스	122,000	0.83	347.4	63.7	236,602	8,656	0.04%	-7,625	4,757	2,543	-6,881	2,413
S-Oil	96,700	-3.30	45.8	61.4	17,970	-5,160	-0.07%	-3,737	4,321	-584	1,827	213
SK 이노베이션	278,000	0.00	136.7	59.1	34,842	1,596	0.08%	2,835	-1,273	-1,573	-1,096	-2,217
신한지주	40,900	-1.09	33.6	58.4	63,774	1,672	0.02%	-3,017	1,232	1,785	-2,022	3,789

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터