

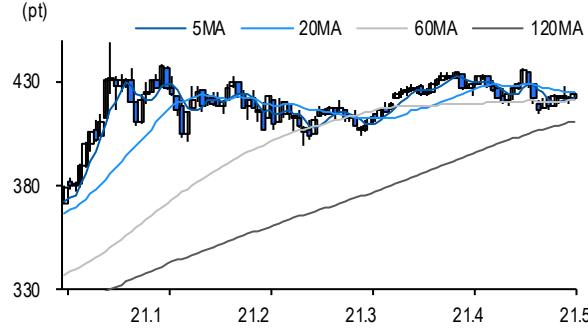


## 선물옵션시장 지표

2021.5.26

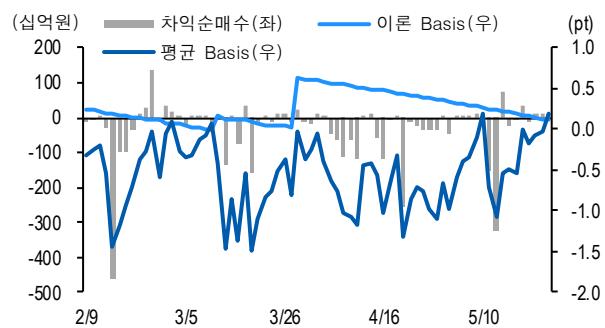
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.35	0.90	3.78	8,440.4	-
선물 6월물	424.95	1.26	5.30	23,425.4	239,428
선물 9월물	424.30	1.20	5.05	37.1	7,661
6월물(mini)	425.04	1.28	5.04	1,626.3	30,448
7월물(mini)	424.06	1.10	4.60	3.0	511



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.12	0.19	0.60	0.02%
베이시스(mini)	0.12	0.18	0.69	0.01%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.55	-0.55	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	0.59	0.59	0.11%



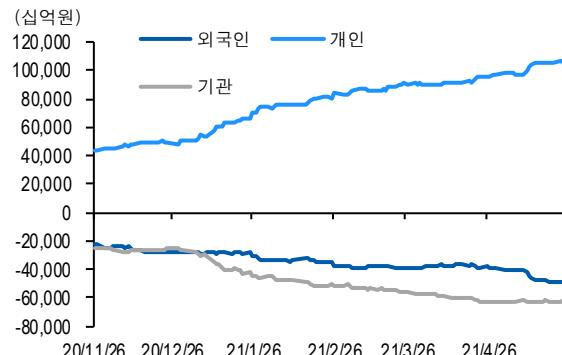
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	68.3	6.3	74.5	0.0	109.6	615.7	73.4	4.7	2.2	34.8
개인	-968.2	-83.1	-1,051.3	0.0	-1.2	-287.2	-61.6	-2.8	1.7	-0.7
기관	883.8	87.8	971.6	12.8	97.1	-342.6	-1.4	-1.4	-2.8	-34.1
금융투자	795.3	71.0	866.3	4.5	45.2	-468.9	-3.1	-1.0	-3.4	-10.7
투신	8.9	46.1	55.0	0.0	-6.8	104.8	1.7	0.0	0.0	-5.9
은행+보험+기타금융	12.8	-7.5	5.3	0.0	12.9	30.6	0.0	-0.4	0.6	0.2
연기금+국가지자체	24.2	-9.4	14.8	8.3	17.0	-9.2	0.0	0.0	0.0	-17.7
기타법인	16.2	-10.9	5.2	0.0	0.1	14.2	-10.5	-0.5	-1.1	0.0

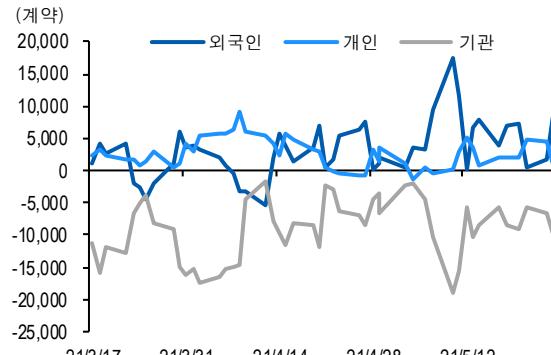
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



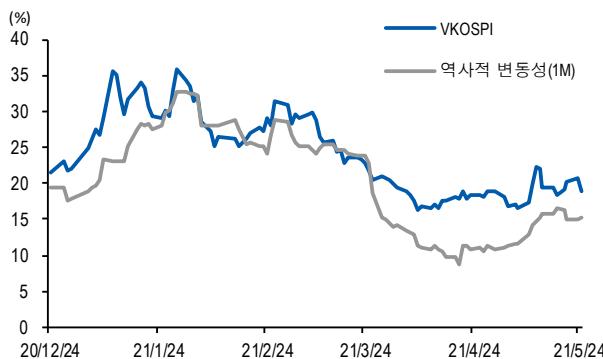
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	515,947	199.9	665,894	17.7%	지수옵션 전체	1,100,823	365.7
Put	584,876	165.9	1,377,209	18.9%	PCR(금액기준)	0.83	VKOSPI 18.99%(-1.60%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	5.08	1.33	6,927	7,174	36	17.7
	425.0(K+2)	6.36	1.62	8,199	10,912	-289	18.1
	422.5(K+1)	7.82	1.99	4,656	6,638	228	18.6
	420.0(K+0)	9.42	2.30	3,436	11,461	-488	19.1
	417.5(K-1)	11.10	2.53	466	3,080	35	19.5
Put	422.5(K+1)	5.37	-3.32	5,435	4,637	565	17.3
	420.0(K+0)	4.48	-3.00	10,125	15,500	1,772	17.8
	417.5(K-1)	3.74	-2.69	5,535	9,473	-201	18.4
	415.0(K-2)	3.11	-2.42	13,642	14,571	1,433	18.9
	412.5(K-3)	2.59	-2.15	10,236	7,185	-65	19.5

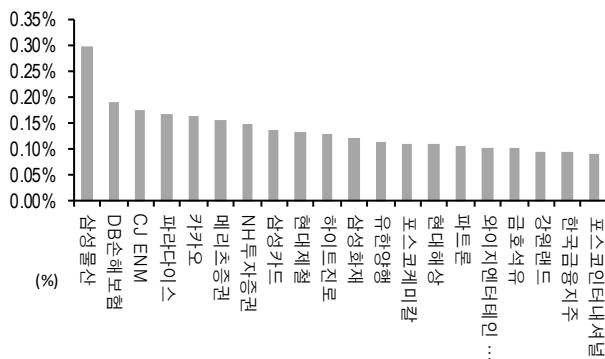
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,660,112	2,908.5	6,136,541	-53,072	-6,370	-20,108	26,130	34.8	-0.7	-34.1
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
하나금융지주	45,950	1.55	42.9	103.2	193,097	4,747	0.09%	-969	-3,287	4,843
SK 텔레콤	313,500	-0.16	85.9	82.3	10,981	-160	0.07%	-842	98	742
삼성전자	80,100	0.63	761.1	75.5	1,211,771	-27,481	-0.05%	25,728	-15,577	-9,738
호텔신라	93,800	2.74	43.7	74.6	47,199	-2,004	-0.09%	1,673	-4,222	2,549
LG 화학	894,000	0.45	101.9	70.1	14,904	-586	-0.04%	-562	264	306
현대차	228,500	-0.22	124.3	70.1	107,916	-1,476	0.05%	-4,315	-2,169	6,482
롯데케미칼	283,500	1.25	18.1	70.0	9,773	108	0.03%	93	118	-211
NAVER	358,500	0.84	101.7	66.3	53,077	3,280	0.05%	733	3,955	-4,780
POSCO	359,000	0.98	88.6	63.7	18,026	801	0.03%	-820	-37	877
엔씨소프트	861,000	2.01	39.1	63.3	3,005	11	0.00%	-65	-2	71

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터