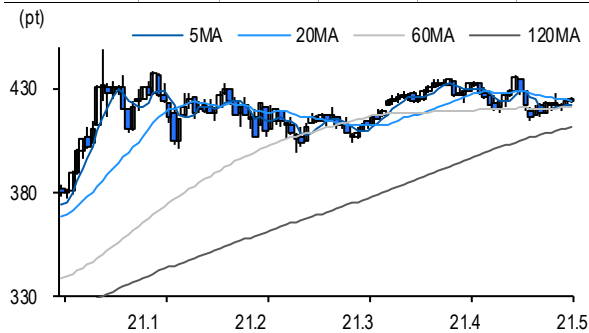


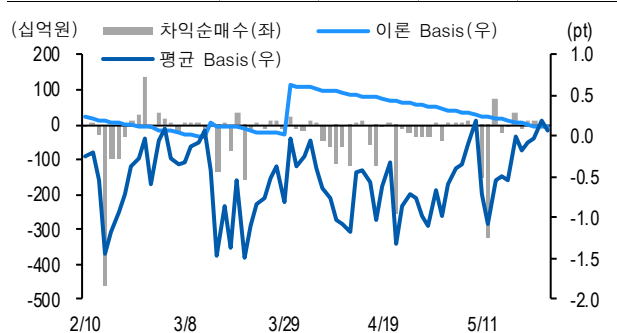
선물옵션시장 지표

2021.5.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	423.54	-0.19	-0.81	9,569.8	-
선물 6월물	423.40	-0.36	-1.55	21,126.3	241,232
선물 9월물	422.85	-0.34	-1.45	52.2	8,510
6월물(mini)	423.38	-0.37	-1.66	1,493.4	31,936
7월물(mini)	422.80	-0.30	-1.26	1.9	548



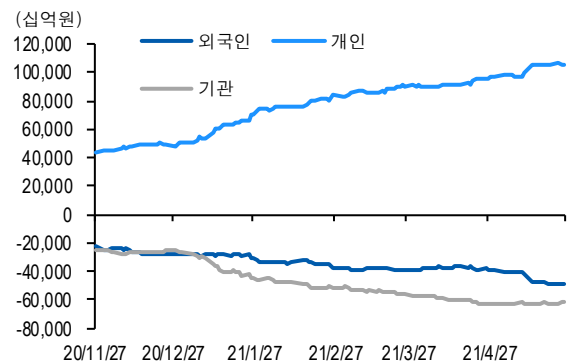
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.11	0.08	-0.14	-0.01%
베이스(mini)	0.11	0.08	-0.16	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.04	-0.55	-0.55	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	-0.13	-0.13	-0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-31.0	27.9	-3.1	-6.6	90.7	-244.9	-34.4	-1.1	1.1	22.6
개인	-239.0	27.7	-211.3	0.0	4.0	191.3	27.7	1.4	-0.6	40.5
기관	282.4	-55.2	227.2	-8.7	42.2	39.9	4.1	0.0	-0.7	-73.9
금융투자	258.0	-66.6	191.4	-0.4	39.8	268.2	3.5	0.0	-0.7	-47.6
투신	31.4	0.2	31.5	0.0	-19.6	-251.3	0.4	0.0	0.1	-28.9
은행+보험+기타금융	-5.9	12.0	6.0	0.0	4.7	15.7	0.1	0.0	-0.2	1.5
연기금+국가지자체	-21.3	0.1	-21.2	-8.3	7.6	7.3	0.1	0.0	0.0	1.1
기타법인	-12.4	-0.4	-12.8	0.0	0.7	13.8	2.7	-0.3	0.2	10.7

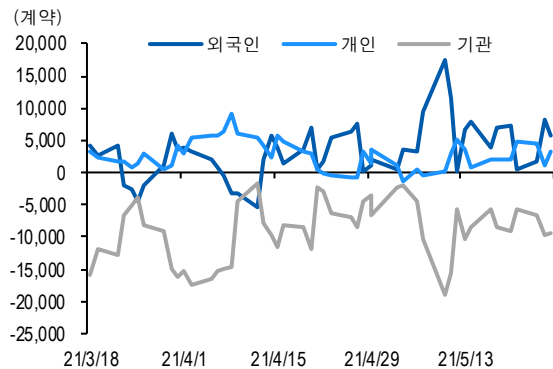
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



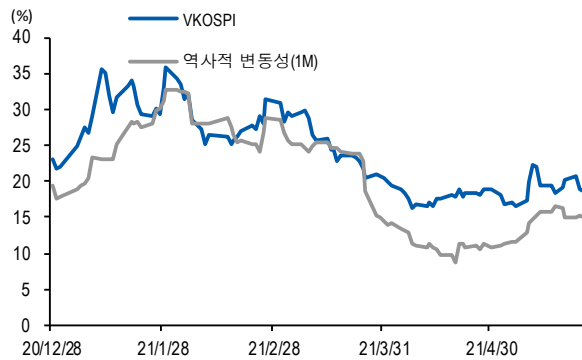
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	478,372	165.3	676,711	16.0%	지수옵션 전체	1,138,620	355.0	2,083,041
Put	660,248	189.7	1,406,330	18.2%	PCR(금액기준)	1.15	VKOSPI	18.68%(-0.31%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	432.5(K+3)	2.36	-0.76	27,964	9,706	1,312	16.0	Put	427.5(K+1)	7.92	0.22	1,981	2,048	358	16.3
	430.0(K+2)	3.13	-0.88	25,827	14,926	1,169	16.1		425.0(K+0)	6.78	0.36	7,321	8,461	825	17.2
	427.5(K+1)	4.06	-1.02	8,639	8,004	830	16.3		422.5(K-1)	5.63	0.26	5,402	5,763	1,126	17.5
	425.0(K+0)	5.19	-1.17	8,173	11,350	438	16.5		420.0(K-2)	4.67	0.19	10,948	17,206	1,706	18.0
	422.5(K-1)	6.54	-1.28	3,527	6,747	109	16.8		417.5(K-3)	3.85	0.11	12,677	9,709	236	18.4

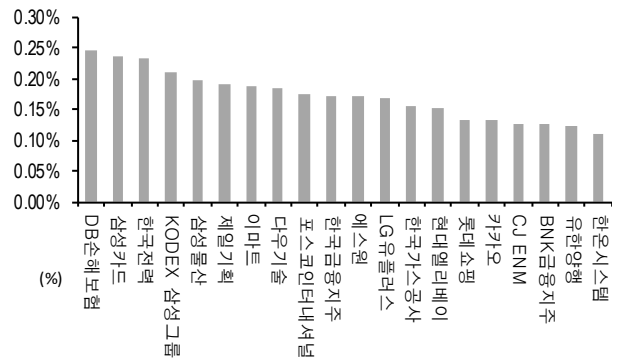
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,150,881	3,204.0	6,388,097	251,556	71,944	90,614	-183,675	22.6	40.5	-73.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	79,700	-0.50	758.2	79.8	1,188,746	-23,025	-0.07%	5,849	-9,648	3,809	10,928	75
하나금융지주	45,300	-1.41	36.2	79.1	195,401	2,304	0.04%	972	2,744	-3,776	-3,815	-427
SK 하이닉스	123,000	0.82	288.3	78.8	211,494	-3,989	0.02%	20	-20,318	20,455	11,587	-1,982
엔씨소프트	856,000	-0.58	35.8	71.6	3,178	173	-0.03%	17	-211	175	-9	214
KB 금융	57,100	-1.55	36.6	62.6	43,783	-2,250	0.04%	-2,804	1,026	1,769	1,250	4,524
호텔신라	98,300	4.80	96.5	57.1	51,089	3,890	-0.05%	1,736	-1,764	-302	-137	-990
SK 텔레콤	319,500	1.91	56.3	55.3	11,537	556	0.00%	702	-151	-543	-391	-6
삼성 SDI	636,000	-1.24	68.3	55.3	25,306	1,046	0.06%	-562	652	4	20	15
현대차	223,500	-2.19	133.1	54.5	101,232	-6,684	0.05%	-395	3,461	-3,169	2,040	2,646
신세계	314,000	3.29	30.2	52.8	5,093	1,302	0.11%	140	-386	265	322	-490

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터