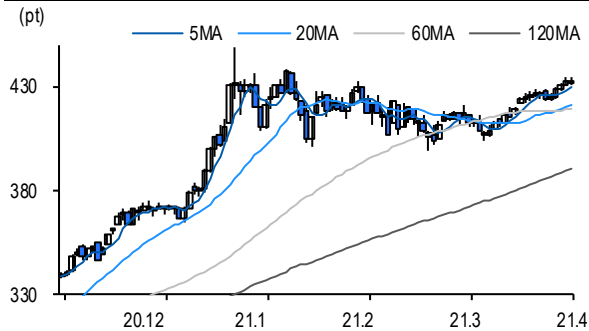


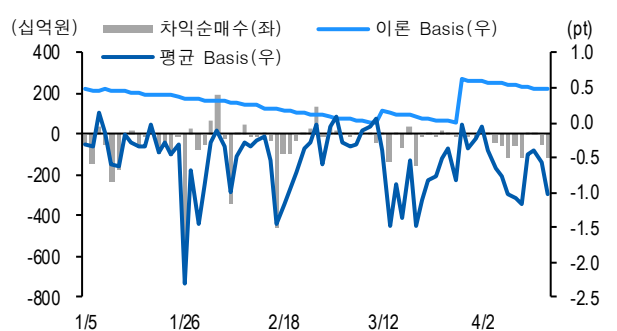


선물옵션시장 지표 2021.4.19

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	432.43	-0.05	-0.23	10,021.7	-
선물 6월물	431.10	-0.07	-0.30	21,619.6	237,712
선물 9월물	430.40	-0.16	-0.70	13.0	3,762
5월물(mini)	431.08	-0.06	-0.26	1,876.3	40,522
6월물(mini)	431.10	-0.07	-0.46	3.4	4,350

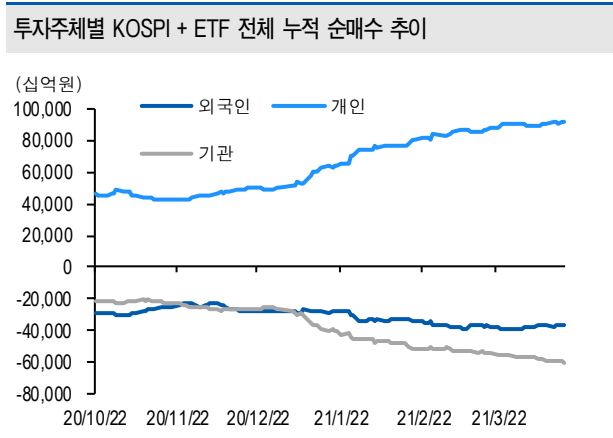


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.48	-1.03	-1.33	-0.35%
베이스(mini)	0.23	-0.96	-1.35	-0.28%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.47	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.23	-1.34	-1.34	-0.36%

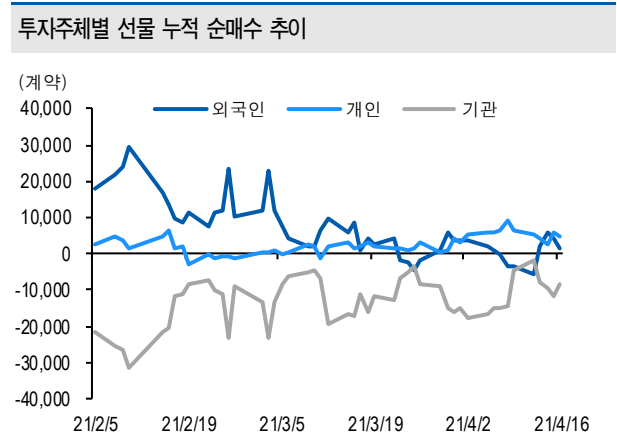


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-213.4	6.2	-207.2	-60.3	-107.9	-235.9	-36.8	1.5	1.2	-14.0
개인	670.2	-15.3	654.9	0.0	-0.2	-87.5	-11.1	-0.9	0.6	84.9
기관	-477.5	7.7	-469.8	-56.8	-173.1	317.0	48.4	-0.3	-1.9	-71.5
금융투자	-373.9	-38.9	-412.8	-30.4	-57.5	261.9	48.7	-0.4	-2.2	-59.9
투신	-99.1	23.0	-76.1	0.0	-76.7	16.9	0.0	-0.1	0.0	26.5
은행+보험+기타금융	-39.6	10.9	-28.7	0.0	-24.8	8.8	-0.3	0.1	0.2	-2.3
연기금+국가자재	51.5	5.2	56.7	-26.4	-3.6	29.4	0.0	0.0	0.0	-35.8
기타법인	20.7	1.4	22.2	0.0	0.2	6.5	-0.5	-0.3	0.1	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





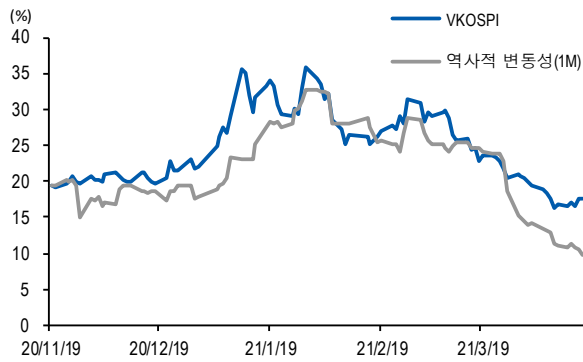
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	409,526	198.9	603,630	14.1%	지수옵션 전체	973,778	415.8	1,723,157		
Put	564,252	216.9	1,119,527	17.4%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	17.61%(+0.01%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	3.82	-0.23	25,716	18,808	-297	14.3	Put	435.0(K+1)	9.53	0.17	2,371	2,014	290	17.4
	437.5(K+2)	4.67	-0.22	6,977	5,204	-103	14.2		432.5(K+0)	8.14	-0.06	3,121	3,367	474	17.2
	435.0(K+1)	5.62	-0.25	9,215	7,915	-295	14.0		430.0(K-1)	6.93	-0.05	6,269	5,091	1,013	17.2
	432.5(K+0)	6.73	-0.27	7,980	6,762	1,222	13.9		427.5(K-2)	5.90	-0.01	4,218	5,720	337	17.3
	430.0(K-1)	8.00	-0.29	5,447	7,401	953	13.8		425.0(K-3)	4.99	-0.03	9,904	7,496	39	17.5

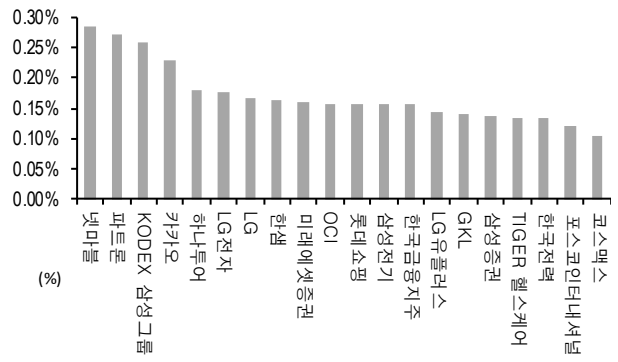
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,239,923	3,118.0	7,319,022	129,704	-43,611	98,001	-55,993	-14.0	84.9	-71.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	41,050	-1.79	34.8	81.8	157,576	2,015	0.08%	-4,801	1,071	3,730	-587	-310
삼성전자	84,000	-0.12	948.5	73.6	1,517,579	8,689	-0.03%	-7,408	13,939	-4,968	-1,894	-3,500
SK 텔레콤	301,000	0.33	69.0	68.3	14,382	-1,369	-0.26%	-1,412	-980	2,393	412	659
LG 화학	898,000	0.67	161.2	66.2	17,328	677	0.01%	540	549	-1,048	-309	-784
POSCO	344,000	-0.72	66.9	64.7	19,679	-666	-0.09%	-880	712	168	445	-39
삼성증권	41,750	0.85	10.6	59.8	79,860	11,642	0.14%	-1,443	10,757	-9,714	-2,554	-7,270
SK 이노베이션	277,500	0.00	87.8	58.9	43,150	-1,597	0.01%	-692	455	237	595	1,881
삼성 SDI	696,000	-0.85	118.3	56.3	28,947	677	0.05%	-238	901	-656	-421	-197
엔씨소프트	922,000	0.44	26.7	55.7	3,637	238	-0.32%	52	146	-198	2	68
기아	87,100	1.99	212.1	50.7	147,163	21,486	0.05%	1,375	10,066	-11,614	-17,428	-1,161

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터