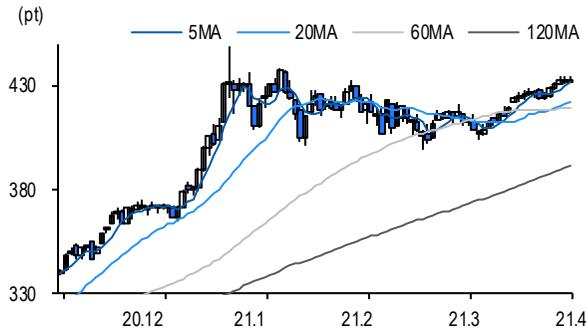


선물옵션시장 지표

2021.4.20

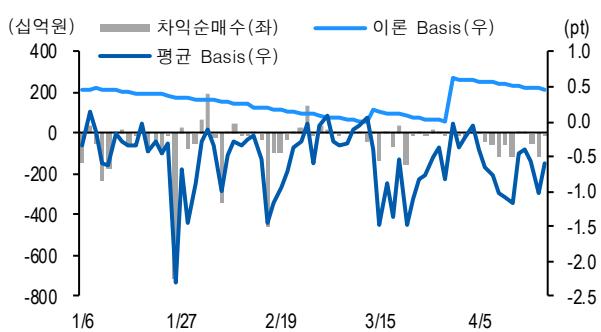
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.96	-0.11	-0.47	10,057.5	-
선물 6월물	431.20	0.02	0.10	19,909.2	238,934
선물 9월물	430.90	0.12	0.50	15.2	3,797
5월물(mini)	431.20	0.03	0.12	1,860.5	42,209
6월물(mini)	431.32	0.05	0.22	3.2	4,348



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.45	-0.61	-0.76	-0.25%
베이시스(mini)	0.21	-0.60	-0.76	-0.19%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.48	-0.45	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.21	-0.76	-0.76	-0.22%



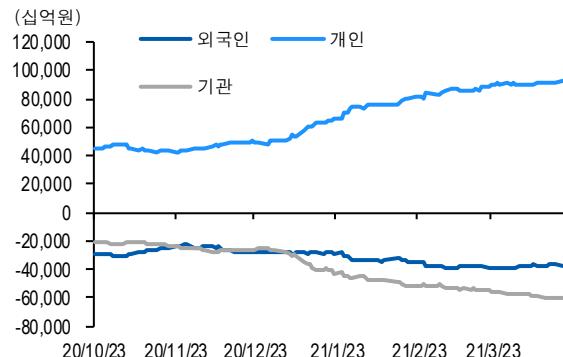
투자주체별 매매 동향

(십억원)

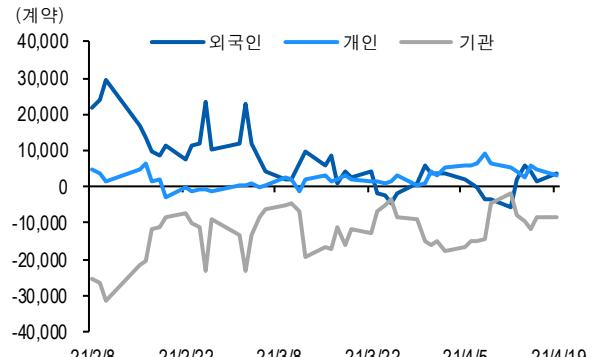
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-308.7	-4.1	-312.7	-8.4	-324.3	241.2	-24.7	-3.2	-0.5	1.4
개인	395.9	-2.0	393.9	0.0	-1.5	-161.8	5.3	1.3	1.3	20.5
기관	-114.2	-5.1	-119.3	4.8	-189.3	-47.0	19.7	1.0	-0.8	-23.2
금융투자	35.7	-35.4	0.3	-17.1	-30.3	-208.0	19.5	1.0	-1.0	-1.6
투신	-76.2	1.4	-74.7	0.0	-52.6	187.2	0.0	0.0	0.0	-45.3
은행+보험+기타금융	-2.7	6.7	4.0	0.0	-9.6	-1.3	0.3	0.0	0.3	-1.0
연기금+국가지자체	-37.2	9.9	-27.3	17.6	-92.8	-24.9	-0.1	0.0	0.0	24.8
기타법인	26.9	11.2	38.2	0.0	-1.0	-32.4	-0.3	0.9	0.0	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

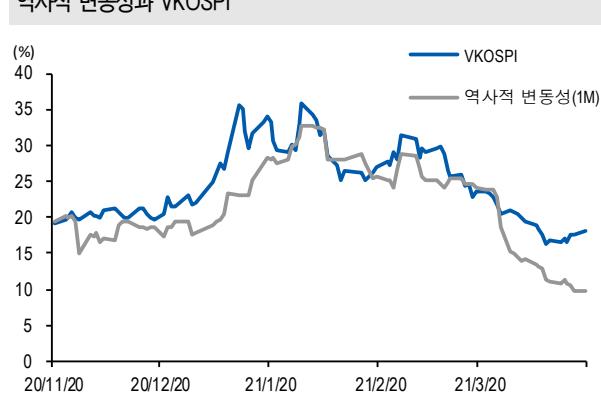


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

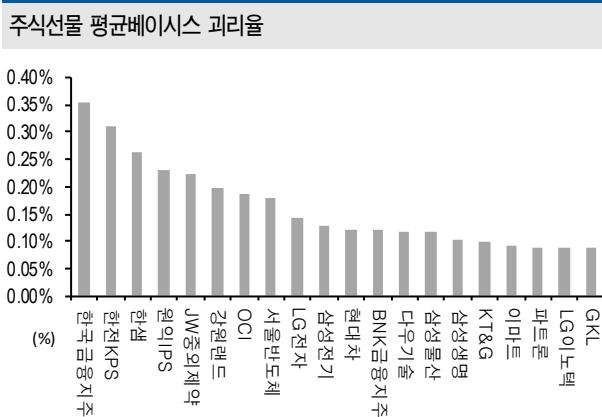
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	516,638	239.2	618,717	15.0%	지수옵션 전체		937,380	420.8	1,761,041						
Put	420,742	181.6	1,142,324	17.3%	PCR(금액기준)		0.76	VKOSPI	18.04%(+0.43%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량			
Call	440.0(K+3)	3.63	-0.19	30,079	18,215	-593	15.0	Put	435.0(K+1)	9.27	-0.26	2,597	2,293	279	17.2
	437.5(K+2)	4.44	-0.23	8,116	5,245	41	14.9		432.5(K+0)	7.82	-0.32	5,273	4,506	1,139	17.0
	435.0(K+1)	5.47	-0.15	9,230	8,316	401	15.0		430.0(K-1)	6.64	-0.29	6,978	5,852	761	17.1
	432.5(K+0)	6.52	-0.21	7,753	7,599	837	14.8		427.5(K-2)	5.60	-0.30	4,306	5,739	19	17.2
	430.0(K-1)	7.80	-0.20	4,263	7,306	-95	14.8		425.0(K-3)	4.72	-0.27	12,171	8,026	530	17.4

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	2,973,105	3,021.2	7,422,494	103,472	29,851	46,159	-78,690	1.4	20.5	-23.2		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KT	28,200	-0.70	13.4	64.1	93,986	8,731	-0.66%	7,283	-637	-7,076	677	4,327
삼성전자	83,500	-0.60	782.7	61.5	1,524,849	7,270	-0.11%	-3,617	9,946	-6,330	17,967	1,300
POSCO	353,500	2.76	80.1	59.9	20,770	1,091	-0.02%	423	-803	351	-134	-194
LG 화학	880,000	-2.00	140.4	59.9	17,259	-69	0.02%	-816	142	666	293	415
LG 전자	171,000	1.18	229.0	58.6	70,747	1,317	0.14%	3,691	870	-4,581	-5,784	1,504
하나금융지주	40,850	-0.49	13.4	57.8	154,534	-3,042	0.00%	-849	-1,534	2,503	907	3,214
현대모비스	305,500	-0.49	51.9	56.7	12,625	-142	0.06%	361	-305	-56	-150	94
현대차	230,000	-0.65	90.5	55.0	78,317	-893	0.12%	-1,116	-323	1,440	2,690	-141
삼성 SDI	689,000	-1.01	78.4	54.0	29,067	120	0.07%	46	277	-242	27	-112
NAVER	389,500	-0.64	92.0	52.6	60,710	-167	-0.06%	-1,608	-106	1,713	1,079	634

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터