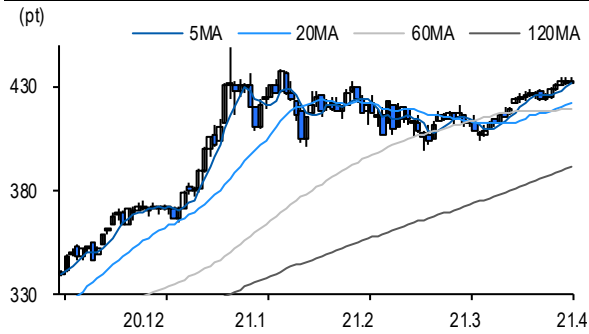


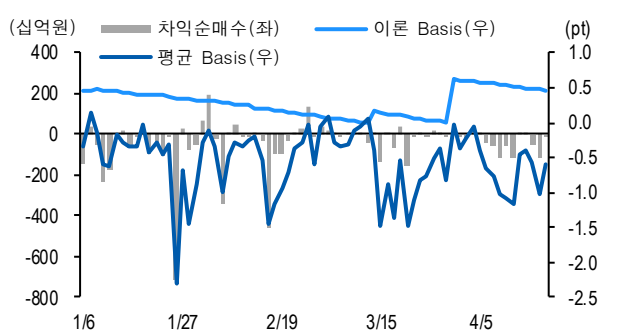
선물옵션시장 지표

2021.4.20

| Market Data (십억원, 계약) | | | | | |
|-----------------------|--------|--------|---------|----------|---------|
| | 증가(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 |



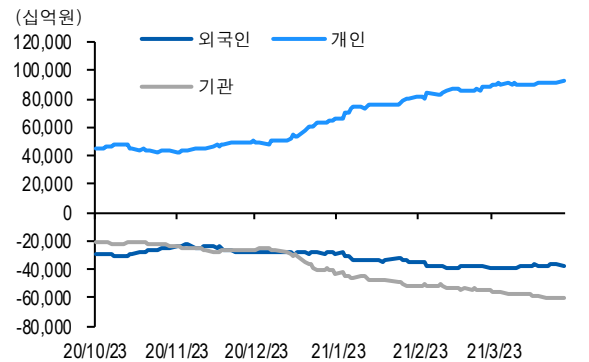
| 차익거래 관련 Market data (pt) | | | | |
|--------------------------|------|-------|-------|--------|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
| K200 베이스스 | 0.45 | -0.61 | -0.76 | -0.25% |
| 베이스스(mini) | 0.21 | -0.60 | -0.76 | -0.19% |
| 제1스프레드(SP) | 0.13 | -0.48 | -0.45 | -0.14% |
| 합성선물 베이스스(ATM) | 0.21 | -0.76 | -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+국가자재 | -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 |

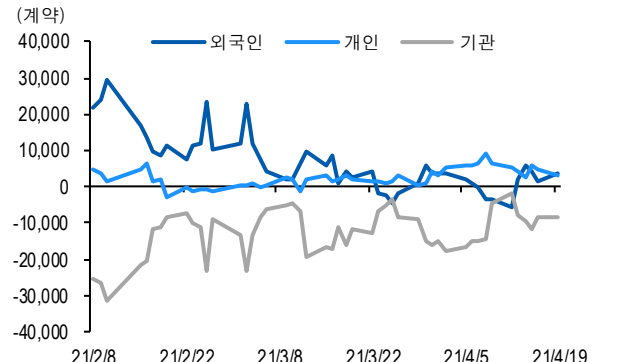
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



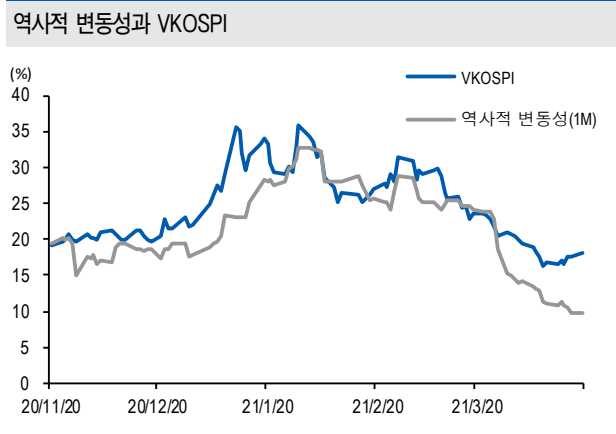


선물옵션시장 지표

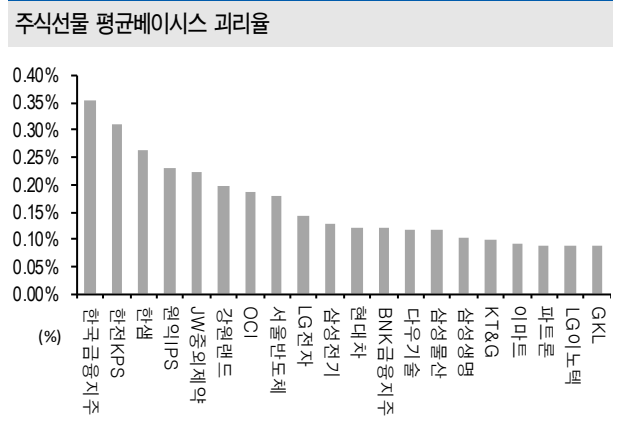
| 지수옵션 시장동향 | | | | | (계약, 십억원) | | | |
|-----------|---------|-------|-----------|-------|-----------|---------|--------|-----------------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 |
| Call | 516,638 | 239.2 | 618,717 | 15.0% | 지수옵션 전체 | 937,380 | 420.8 | 1,761,041 |
| Put | 420,742 | 181.6 | 1,142,324 | 17.3% | PCR(금액기준) | 0.76 | VKOSPI | 18.04%(+0.43%p) |

| | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|------|--------|--------|--------|-------|-------|-----|------------|------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 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, 유안타증권 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