

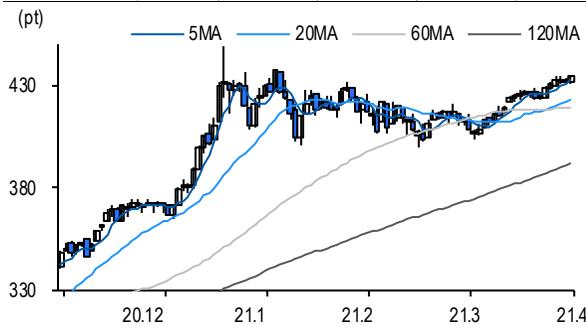
## 선물옵션시장 지표

2021.4.21

### Market Data

(십억원, 계약)

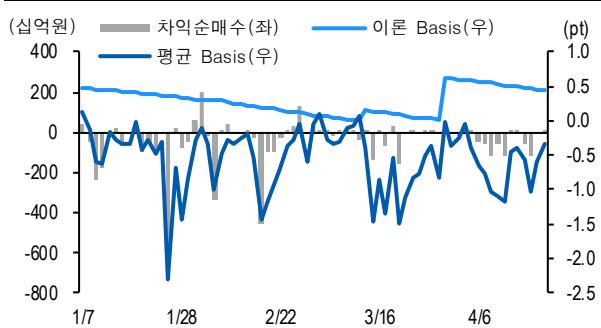
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.60	0.61	2.64	9,078.1	-
선물 6월물	433.20	0.46	2.00	20,402.2	237,783
선물 9월물	433.15	0.52	2.25	24.1	3,784
5월물(mini)	433.26	0.48	2.06	1,903.5	46,223
6월물(mini)	433.40	0.51	2.08	3.0	4,268



### 차익거래 관련 Market data

(pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.44	-0.33	-1.40	-0.18%
베이시스(mini)	0.20	-0.39	-1.34	-0.14%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.45	-0.45	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.20	-1.41	-1.41	-0.37%



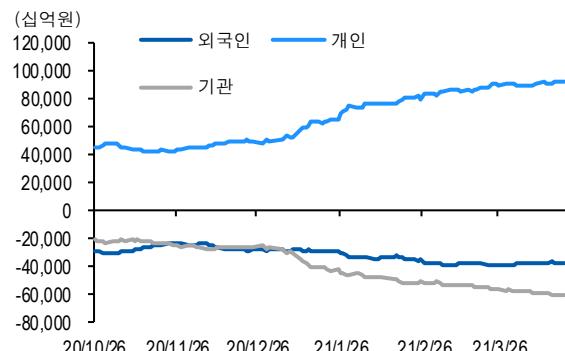
### 투자주체별 매매 동향

(십억원)

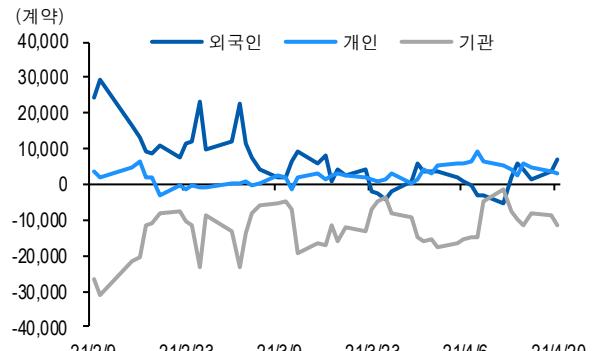
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	327.4	-24.2	303.2	1.3	446.1	442.6	-43.5	2.7	0.7	8.7
개인	-389.5	25.0	-364.5	0.0	-4.6	-55.1	17.2	-1.7	1.0	-11.8
기관	46.5	-2.1	44.3	2.2	-210.5	-387.9	26.3	-1.0	-1.6	2.6
금융투자	300.4	-73.7	226.7	0.0	-11.9	-373.5	26.5	-0.9	-2.4	1.6
투신	-67.2	0.8	-66.4	0.0	-61.6	-9.1	0.0	0.0	0.1	2.4
은행+보험+기타금융	9.7	64.8	74.4	0.0	5.5	4.4	-0.2	0.0	0.7	6.6
연기금+국가지자체	-129.3	4.4	-124.9	2.2	-92.3	-9.8	0.0	0.0	0.0	-8.0
기타법인	15.7	1.3	17.0	0.0	-0.1	0.4	0.1	-0.1	-0.1	0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

### 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



### 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



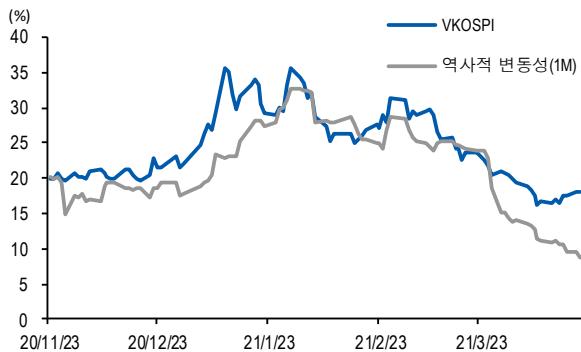
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	500,092	219.0	628,020	14.2%	지수옵션 전체	880,045	381.0	1,796,311	
Put	379,953	162.1	1,168,291	17.9%	PCR(금액기준)	0.74	VKOSPI	17.96%(-0.08%p)	
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가
	440.0(K+3)	4.17	0.54	26,284	18,240	25	14.4		435.0(K+1)
	437.5(K+2)	5.06	0.62	7,451	5,229	-16	14.2		432.5(K+0)
	435.0(K+1)	6.15	0.68	8,643	9,070	754	14.0		430.0(K-1)
	432.5(K+0)	7.41	0.89	7,747	8,034	435	14.0		427.5(K-2)
	430.0(K-1)	8.84	1.04	3,899	7,076	-230	13.9		425.0(K-3)
주제: KRX, 유인타증권 리서치센터									

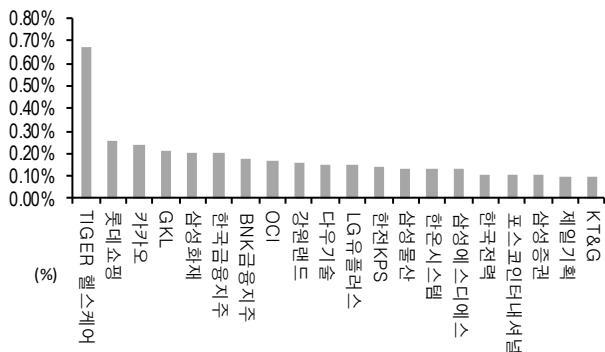
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	2,980,957	2,749.2	7,534,874	112,380	58,506	-29,241	-31,554	8.7	-11.8	2.6	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
LG 화학	890,000	1.14	155.4	76.0	18,762	1,503	0.05%	437	69	-514	201
삼성전자	84,100	0.72	887.1	69.3	1,517,492	-7,357	-0.06%	-1,957	-7,939	9,852	15,206
삼성생명	82,100	1.11	35.1	65.8	35,785	1,080	-0.06%	1,603	386	-1,952	-8,028
삼성 SDI	691,000	0.29	78.9	59.9	28,814	-253	0.06%	127	-222	194	65
하나금융지주	42,500	4.04	32.9	58.7	171,124	16,590	0.07%	6,993	-111	-6,512	-5,936
SK 텔레콤	305,500	1.66	36.9	54.9	11,648	-824	-0.03%	328	-499	174	-347
POSCO	355,000	0.42	63.8	53.5	19,446	-1,324	-0.14%	-77	-554	647	412
기아	85,800	0.12	75.4	49.1	138,187	-4,247	0.01%	-1,372	-1,510	3,207	557
SK 이노베이션	269,000	-1.10	88.6	48.1	39,640	-580	-0.01%	635	2,521	-3,088	411
금호석유	268,000	0.94	68.0	46.6	21,033	-34	0.04%	-2,205	638	1,567	419
											546

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터