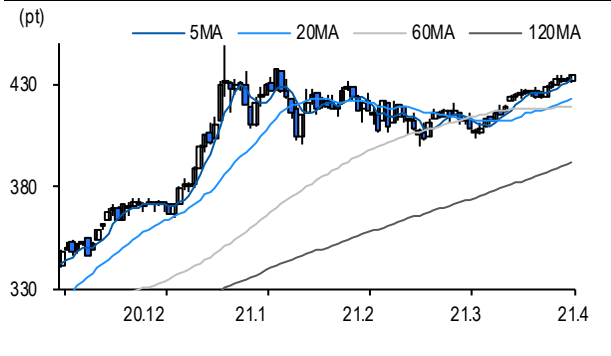


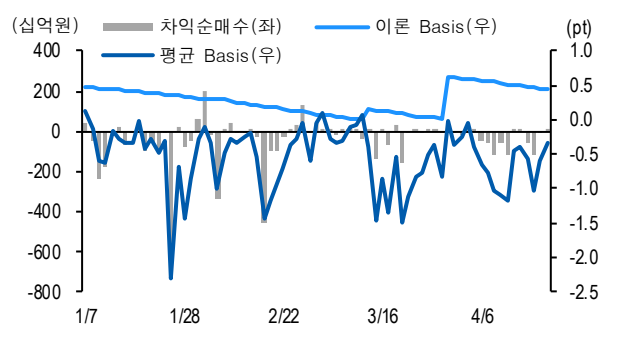


선물옵션시장 지표 2021.4.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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

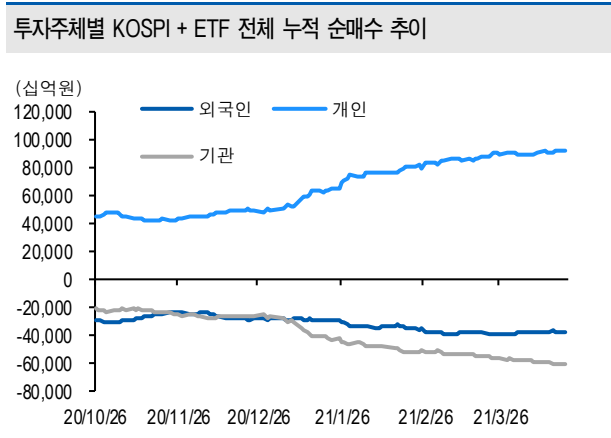


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.44	-0.33	-1.40	-0.18%
베이스(mini)	0.20	-0.39	-1.34	-0.14%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.45	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.20	-1.41	-1.41	-0.37%

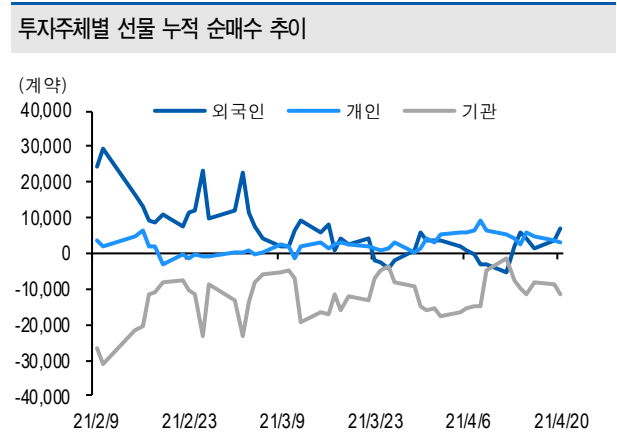


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	327.4	-24.2	303.2	1.3	446.1	442.6	-43.5	2.7	0.7	8.7
개인	-389.5	25.0	-364.5	0.0	-4.6	-55.1	17.2	-1.7	1.0	-11.8
기관	46.5	-2.1	44.3	2.2	-210.5	-387.9	26.3	-1.0	-1.6	2.6
금융투자	300.4	-73.7	226.7	0.0	-11.9	-373.5	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+국가자재	-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



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





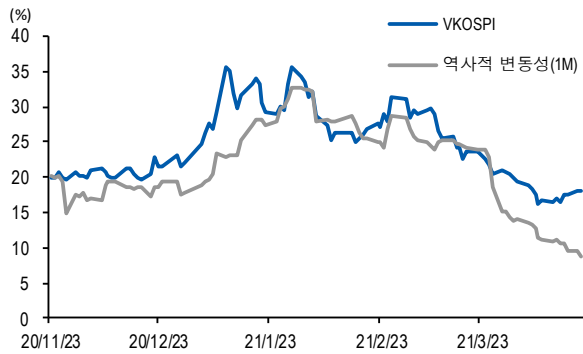
선물옵션시장 지표

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)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	4.17	0.54	26,284	18,240	25	14.4	Put	435.0(K+1)	7.96	-1.31	3,997	3,170	877	17.7
	437.5(K+2)	5.06	0.62	7,451	5,229	-16	14.2		432.5(K+0)	6.72	-1.10	6,168	6,024	1,518	17.6
	435.0(K+1)	6.15	0.68	8,643	9,070	754	14.0		430.0(K-1)	5.66	-0.98	6,159	6,552	700	17.7
	432.5(K+0)	7.41	0.89	7,747	8,034	435	14.0		427.5(K-2)	4.74	-0.86	5,241	6,476	737	17.8
	430.0(K-1)	8.84	1.04	3,899	7,076	-230	13.9		425.0(K-3)	3.99	-0.73	11,270	9,080	1,054	18.1

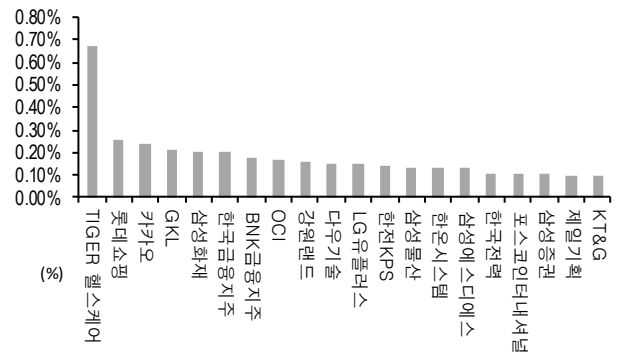
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	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	연기금등 순매수
LG 화학	890,000	1.14	155.4	76.0	18,762	1,503	0.05%	437	69	-514	201	-1,328
삼성전자	84,100	0.72	887.1	69.3	1,517,492	-7,357	-0.06%	-1,957	-7,939	9,852	15,206	-2,900
삼성생명	82,100	1.11	35.1	65.8	35,785	1,080	-0.06%	1,603	386	-1,952	-8,028	6,070
삼성 SDI	691,000	0.29	78.9	59.9	28,814	-253	0.06%	127	-222	194	65	128
하나금융지주	42,500	4.04	32.9	58.7	171,124	16,590	0.07%	6,993	-111	-6,512	-5,936	-10,587
SK 텔레콤	305,500	1.66	36.9	54.9	11,648	-824	-0.03%	328	-499	174	-347	-956
POSCO	355,000	0.42	63.8	53.5	19,446	-1,324	-0.14%	-77	-554	647	412	1,105
기아	85,800	0.12	75.4	49.1	138,187	-4,247	0.01%	-1,372	-1,510	3,207	557	3,983
SK 이노베이션	269,000	-1.10	88.6	48.1	39,640	-580	-0.01%	635	2,521	-3,088	411	-1,286
금호석유	268,000	0.94	68.0	46.6	21,033	-34	0.04%	-2,205	638	1,567	419	546

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터