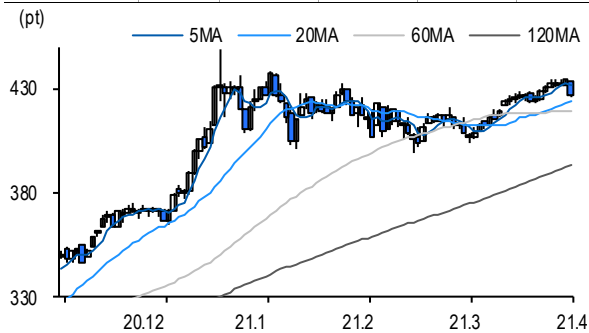


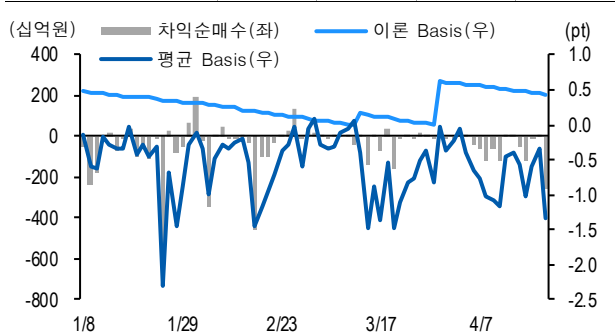
선물옵션시장 지표

2021.4.22

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	426.75	-1.81	-7.85	11,320.9	-
선물 6월물	425.65	-1.74	-7.55	24,152.7	243,034
선물 9월물	425.25	-1.82	-7.90	13.5	3,960
5월물(mini)	426.00	-1.68	-7.26	2,692.1	40,815
6월물(mini)	425.74	-1.72	-7.66	8.8	5,027



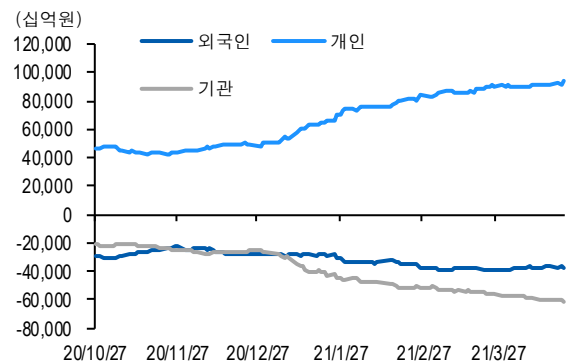
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.43	-1.33	-1.10	-0.41%
베이스(mini)	0.19	-1.01	-0.75	-0.28%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.43	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.19	-0.62	-0.62	-0.19%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,428.8	-47.1	-1,475.9	-141.3	-868.6	-1,079.1	356.6	-5.5	25.6	-14.0
개인	2,711.9	66.3	2,778.3	0.0	0.5	-286.4	11.5	3.2	-20.9	-102.6
기관	-1,283.8	-22.7	-1,306.5	-116.0	-315.5	1,417.4	-388.0	3.0	-4.6	128.6
금융투자	-763.1	-158.4	-921.5	-81.3	-39.3	1,613.7	-385.0	3.0	-4.6	159.1
투신	-98.4	18.3	-80.1	0.0	-50.5	-279.0	-1.9	0.0	0.0	-75.6
은행+보험+기타금융	-32.4	89.5	57.1	-2.1	-16.9	30.8	-1.0	0.0	0.0	3.3
연기금+국가지자체	-261.5	8.8	-252.7	-32.6	-116.4	51.9	-0.1	0.0	0.0	41.8
기타법인	0.7	3.5	4.1	0.0	-0.2	-51.9	19.8	-0.6	-0.1	-12.0

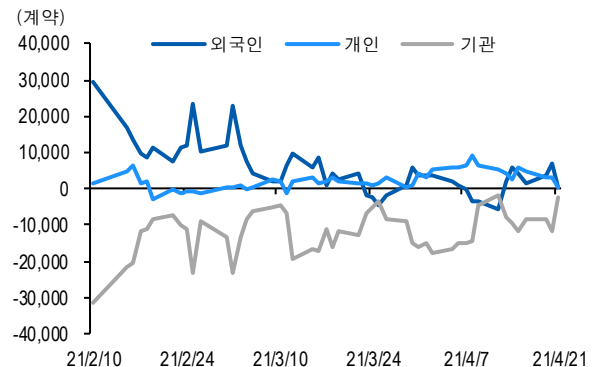
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



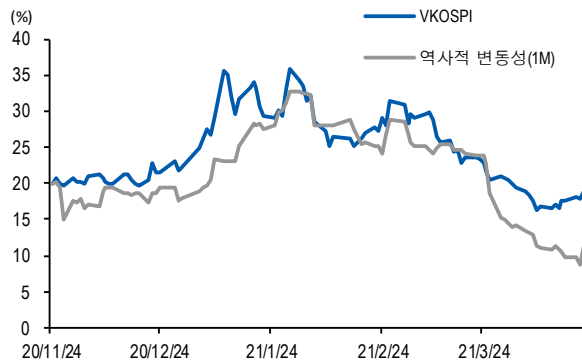
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	554,092	200.8	659,531	15.6%	지수옵션 전체	1,325,321	545.6	1,844,048
Put	771,229	344.7	1,184,517	17.7%	PCR(금액기준)	1.72	VKOSPI	18.95%(+0.99%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	1.71	-1.63	35,672	10,288	2,478	15.8	Put	437.5(K+1)	14.20	4.99	664	847	65	18.1
	440.0(K+2)	2.16	-2.01	45,199	21,166	2,926	15.6		435.0(K+0)	12.25	4.29	1,844	3,045	-125	17.5
	437.5(K+1)	2.73	-2.33	18,445	6,069	840	15.6		432.5(K-1)	10.70	3.98	5,489	5,753	-271	17.7
	435.0(K+0)	3.38	-2.77	20,338	11,394	2,324	15.4		430.0(K-2)	9.19	3.53	7,770	6,365	-187	17.6
	432.5(K-1)	4.22	-3.19	9,621	8,114	80	15.4		427.5(K-3)	7.83	3.09	9,494	5,530	-946	17.7

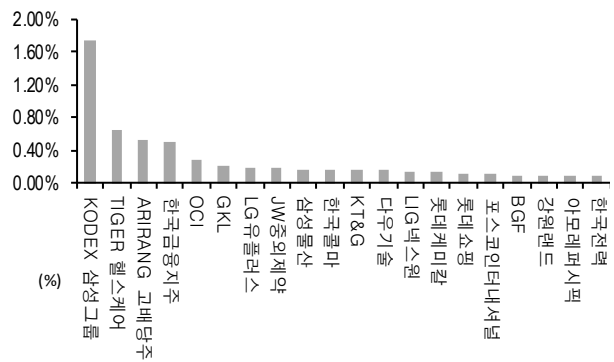
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,519,958	3,482.8	7,381,703	-153,171	-30,906	-132,698	175,515	-14.0	-102.6	128.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 텔레콤	301,500	-1.31	45.2	76.8	11,954	306	0.04%	336	-139	-189	-58	-939
하나금융지주	41,650	-2.00	33.4	73.0	174,315	3,191	0.04%	-3,836	5,001	-1,692	-1,846	18
삼성전자	82,600	-1.78	1,020.1	57.0	1,418,376	-99,116	-0.18%	35,275	-97,571	72,413	71,759	5,501
SK 이노베이션	264,500	-1.67	86.3	56.3	38,337	-1,303	0.00%	1,431	1,102	-2,473	-175	-285
한국금융지주	110,000	-0.45	36.4	54.6	98,752	7,318	0.50%	1,110	2,695	-3,805	-2,864	-4,760
POSCO	350,000	-1.41	82.8	54.5	18,841	-605	-0.12%	-1,507	945	558	873	308
SK 하이닉스	132,500	-3.99	352.4	51.6	291,287	-24,854	-0.06%	-3,146	4,131	-818	21,318	3,550
삼성생명	80,400	-2.07	19.1	51.3	41,629	5,844	-0.03%	-3,354	6,670	-3,317	353	-3,668
삼성 SDI	673,000	-2.60	97.1	51.1	28,569	-245	0.03%	-1,178	-347	1,557	590	1,426
LG 디스플레이	24,600	0.20	36.2	50.7	728,254	-849	-1.16%	-3,949	-11,947	17,406	-4,291	9,010

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터