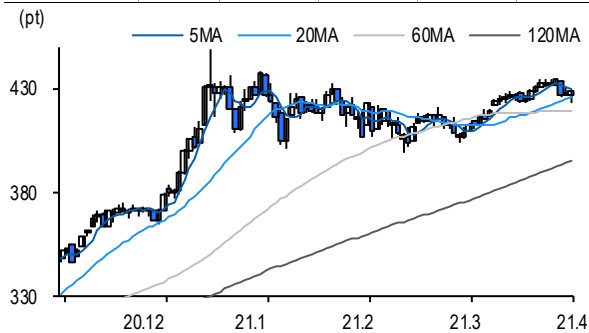


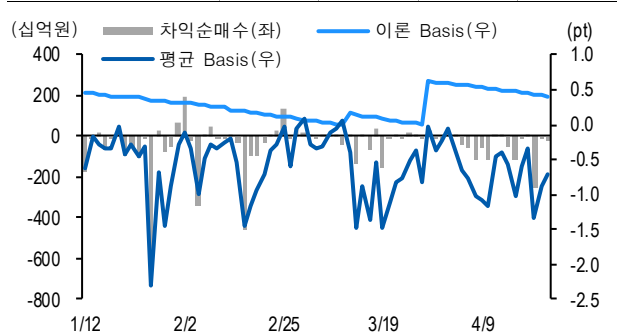
선물옵션시장 지표

2021.4.26

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	428.34	0.23	0.97	9,789.1	-
선물 6월물	426.90	-0.09	-0.40	24,009.5	239,372
선물 9월물	426.45	-0.07	-0.30	22.2	3,922
5월물(mini)	426.88	-0.12	-0.52	2,449.2	47,942
6월물(mini)	427.00	-0.07	0.38	5.6	5,630



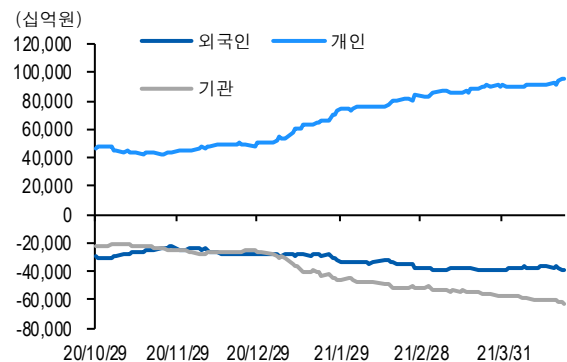
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.41	-0.72	-1.44	-0.26%
베이스(mini)	0.17	-0.65	-1.46	-0.19%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.45	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.17	-1.48	-1.48	-0.39%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-24.7	-26.8	-51.5	-0.4	147.9	616.1	-213.2	3.5	-10.7	25.3
개인	227.7	37.7	265.4	0.0	-4.3	-22.0	-13.5	-4.7	13.5	-17.5
기관	-212.4	-0.4	-212.8	-21.4	-134.7	-582.7	228.7	1.7	-2.7	-8.4
금융투자	16.8	-44.1	-27.3	0.0	-11.0	-603.5	228.7	1.7	-2.4	23.6
투신	0.8	4.2	5.0	0.0	-17.9	37.8	0.0	-0.1	0.0	-47.7
은행+보험+기타금융	-5.6	36.8	31.1	0.0	-2.3	-32.2	0.0	0.0	-0.3	-0.3
연기금+국가지자체	-201.8	-0.4	-202.2	-21.4	-100.4	15.2	0.0	0.0	0.0	16.0
기타법인	9.4	-10.5	-1.1	0.0	-1.0	-11.3	-1.9	-0.5	-0.1	0.7

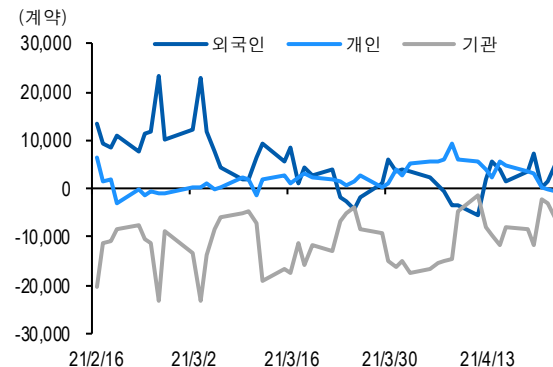
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



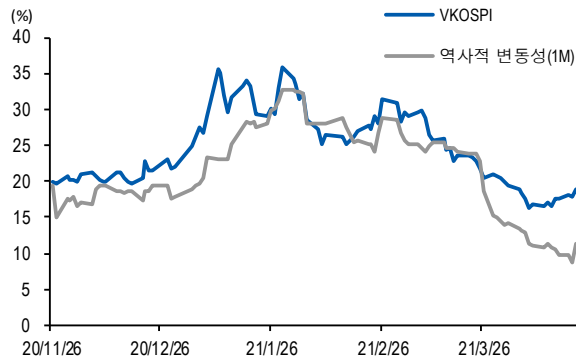
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	813,534	306.2	693,416	14.1%	지수옵션 전체	1,543,514	594.2	1,963,241
Put	729,980	288.0	1,269,825	18.5%	PCR(금액기준)	0.94	VKOSPI	18.33%(+0.47%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	3.20	-0.15	48,173	14,101	1,024	14.2	Put	430.0(K+1)	8.23	0.48	4,154	7,114	1,295	18.2
	432.5(K+2)	4.04	-0.16	32,626	8,333	87	14.1		427.5(K+0)	6.90	0.37	7,822	6,577	378	18.1
	430.0(K+1)	5.06	-0.14	17,838	7,711	42	14.1		425.0(K-1)	5.81	0.39	13,514	10,760	3,154	18.2
	427.5(K+0)	6.26	-0.19	12,434	6,223	-352	14.0		422.5(K-2)	4.85	0.34	10,163	8,107	1,579	18.4
	425.0(K-1)	7.64	-0.21	7,178	6,227	-19	14.0		420.0(K-3)	4.06	0.32	17,318	11,405	350	18.7

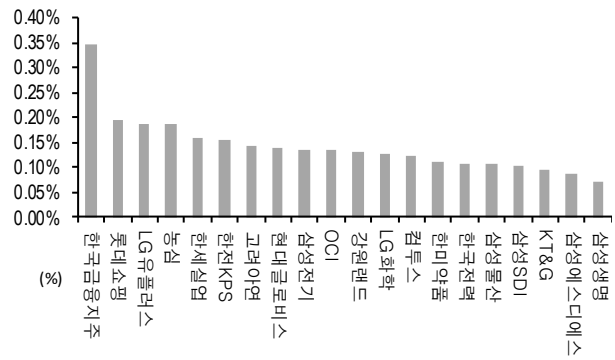
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,202,254	3,684.8	7,481,370	37,014	-13,428	308	10,654	25.3	-17.5	-8.4	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	42,950	2.02	68.4	93.3	187,047	1,924	0.06%	-7,734	4,404	3,576	-6,486	-828
POSCO	354,500	0.42	102.9	89.8	18,149	607	-0.04%	1,306	160	-1,462	-132	-1,715
SK 텔레콤	314,500	1.45	75.3	86.9	10,715	-203	-0.04%	-181	-542	724	158	-701
LG 화학	875,000	0.00	142.7	78.2	20,889	1,627	0.13%	1,078	123	-1,195	-1,074	-1,084
삼성 SDI	671,000	-0.30	94.5	76.7	28,771	260	0.10%	229	-77	-222	-197	-382
삼성전자	82,900	0.48	1,032.8	70.7	1,388,145	-13,346	-0.12%	16,449	-27,888	11,439	12,908	-600
SK 이노베이션	270,000	2.08	154.6	69.1	32,458	-6,118	-0.08%	456	-1,637	1,095	379	4,102
삼성전기	194,000	0.26	29.2	62.4	30,343	571	0.14%	847	704	-1,553	-762	-530
삼성생명	82,400	0.49	16.0	61.2	43,760	2,118	0.07%	1,837	1,264	-3,236	-2,140	-1,091
롯데케미칼	293,000	-1.35	34.7	59.1	13,657	-841	0.05%	-1,317	-59	1,372	243	1,111

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터