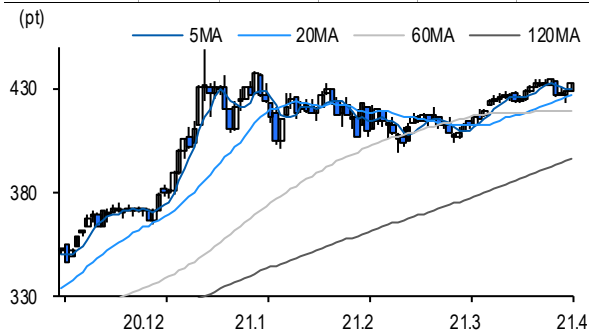


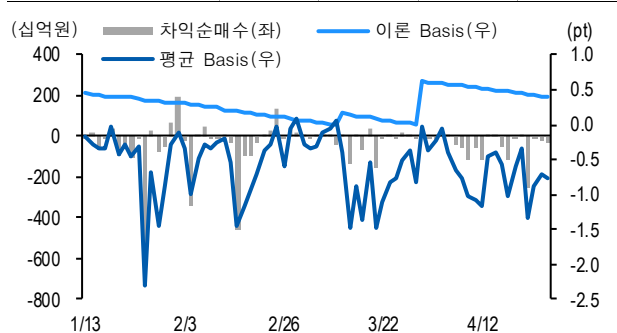
선물옵션시장 지표

2021.4.27

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	432.36	0.94	4.02	10,373.1	-
선물 6월물	431.10	0.98	4.20	19,329.4	238,499
선물 9월물	430.55	0.96	4.10	27.8	3,903
5월물(mini)	431.04	0.97	4.16	1,682.7	49,819
6월물(mini)	430.92	0.94	3.92	4.9	5,511



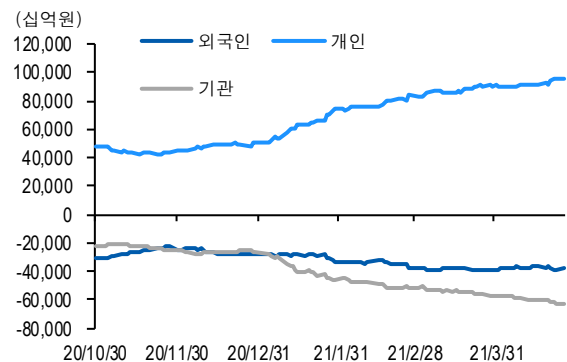
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.39	-0.76	-1.26	-0.27%
베이스(mini)	0.15	-0.75	-1.32	-0.21%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.45	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.15	-1.30	-1.30	-0.33%



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

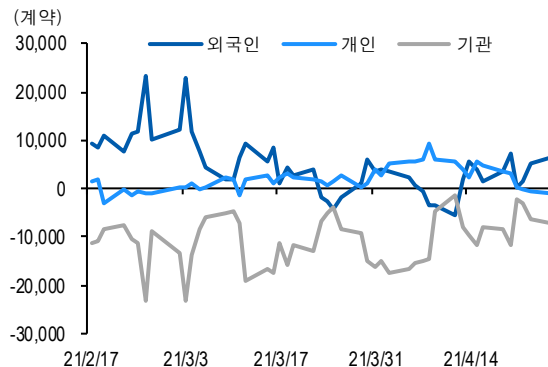
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



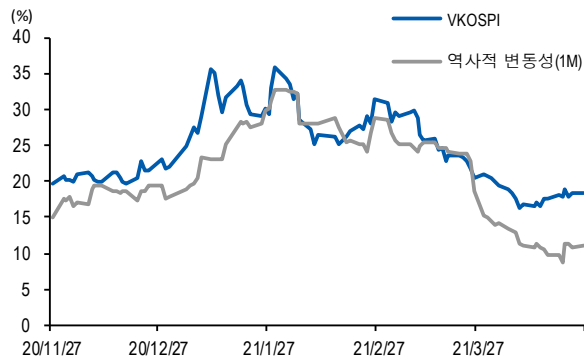
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	495,370	207.7	699,396	14.3%	지수옵션 전체	972,397	369.0	1,995,085
Put	477,027	161.3	1,295,689	19.1%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	18.36%(+0.03%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	4.39	1.19	24,110	14,227	126	14.4	Put	430.0(K+1)	5.80	-2.43	5,309	7,287	173	18.3
	432.5(K+2)	5.50	1.46	7,661	8,724	391	14.3		427.5(K+0)	4.76	-2.14	5,017	6,959	382	18.3
	430.0(K+1)	6.84	1.78	7,748	8,676	965	14.4		425.0(K-1)	3.95	-1.86	8,580	11,620	860	18.7
	427.5(K+0)	8.32	2.06	5,183	6,572	349	14.3		422.5(K-2)	3.26	-1.59	8,506	8,053	-54	19.0
	425.0(K-1)	10.00	2.36	4,883	6,568	341	14.3		420.0(K-3)	2.68	-1.38	26,846	15,775	4,370	19.3

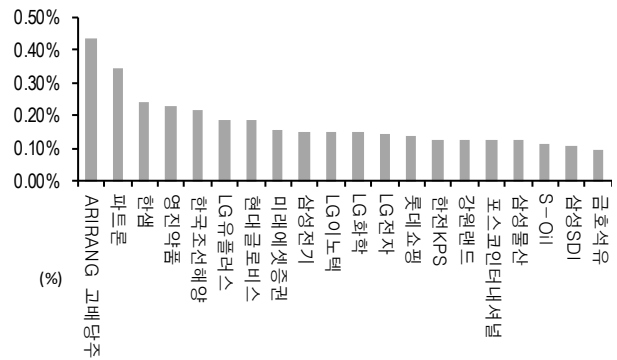
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,830,593	3,259.5	7,527,278	45,908	-5,456	57,371	-51,160	-6.6	50.6	-45.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	42,900	-0.12	61.8	81.9	141,699	-45,348	-0.02%	-7,041	6,611	299	10,526	16,209
LG 화학	884,000	1.03	146.3	76.2	22,325	1,436	0.15%	-228	152	77	-1,163	-110
POSCO	361,500	1.97	129.2	76.0	18,728	579	-0.11%	-1,073	-453	1,529	352	1,030
삼성전자	83,300	0.48	943.4	74.1	1,403,961	15,816	-0.06%	-14,002	15,105	-2,694	-2,437	-5,500
SK 텔레콤	315,500	0.32	57.2	74.0	10,457	-258	0.01%	69	-8	-61	-70	-42
롯데케미칼	297,000	1.37	54.1	66.0	14,891	1,234	0.07%	-98	1,208	-1,104	-921	-200
LG 이노텍	217,000	2.36	20.0	55.5	13,630	1,693	0.15%	1,423	-412	-1,011	-1,415	-1,686
삼성생명	84,900	3.03	48.2	55.2	46,493	2,733	0.03%	-3,261	3,161	66	-762	885
SK 이노베이션	273,500	1.30	104.9	55.2	37,375	4,917	0.07%	723	1,142	-1,848	-2,745	-2,830
LG 디스플레이	26,300	-1.50	82.3	53.8	795,769	-14,165	-1.15%	12,959	-617	-12,972	419	-7,157

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터