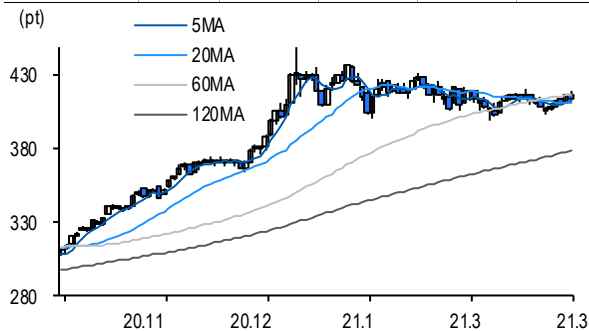


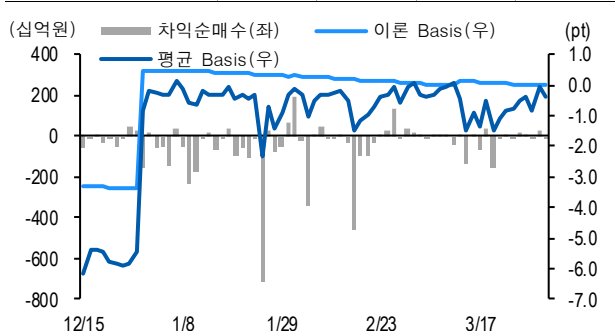
## 선물옵션시장 지표

2021.4.1

Market Data	(십억원, 계약)				
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	415.04	-0.38	-1.57	9,545.0	-
선물 6월물	414.65	-0.22	-0.90	21,593.2	229,547
선물 9월물	414.25	-0.18	-0.75	8.0	3,399
4월물(mini)	414.80	-0.15	-0.62	2,388.6	65,329
5월물(mini)	415.00	-0.14	-0.60	7.0	863



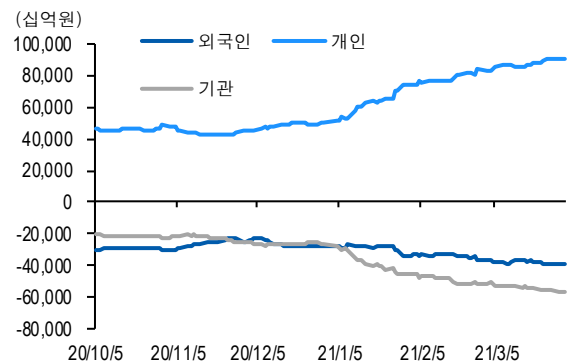
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.00	-0.38	-0.39	-0.09%
베이스(mini)	-0.54	-0.32	-0.24	0.05%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.45	-0.40	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-0.54	-0.18	-0.18	0.09%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-294.0	68.5	-225.5	0.0	-295.1	-329.0	81.8	0.4	0.3	-31.4
개인	639.4	35.2	674.5	0.0	-1.5	346.3	-30.2	0.6	-0.8	51.2
기관	-348.8	-111.1	-459.9	-9.0	-22.1	-67.1	-46.6	-0.4	0.6	-22.6
금융투자	-317.3	-71.1	-388.4	-6.8	9.6	421.0	-45.8	-0.5	-0.4	-66.4
투신	-7.6	-4.3	-12.0	0.0	-5.3	-442.6	-0.2	0.1	0.1	30.3
은행+보험+기타금융	-7.4	-8.4	-15.8	0.0	-18.3	-48.5	-0.6	0.0	0.9	-0.9
연기금+국가지자체	-29.0	0.7	-28.3	-2.2	-7.5	3.1	0.0	0.0	0.0	14.4
기타법인	3.4	7.5	10.9	0.0	0.3	49.7	-5.0	-0.6	-0.1	2.8

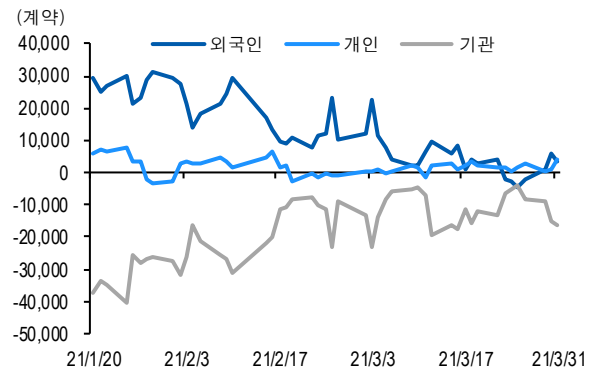
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

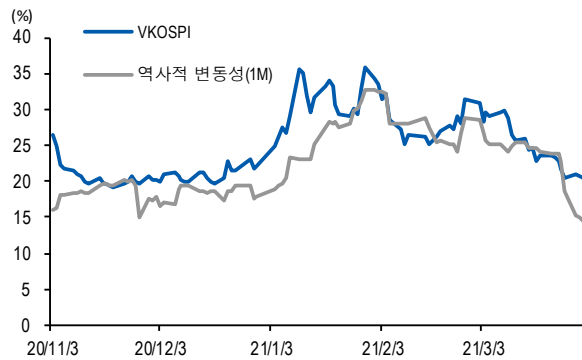
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	773,382	268.6	782,334	17.9%	지수옵션 전체	1,617,047	510.1	1,965,576
Put	843,665	241.5	1,183,242	19.5%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	20.44%(-0.20%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	1.35	-0.47	109,921	19,355	1,700	18.0	Put	420.0(K+1)	7.72	0.27	5,171	4,879	548	18.7
	422.5(K+2)	1.88	-0.52	51,064	10,683	1,395	17.8		417.5(K+0)	6.15	-0.08	11,614	4,939	1,495	18.7
	420.0(K+1)	2.60	-0.60	41,659	16,920	-313	17.7		415.0(K-1)	4.82	-0.15	18,584	7,764	1,694	18.8
	417.5(K+0)	3.51	-0.69	12,725	9,017	742	17.7		412.5(K-2)	3.75	-0.20	28,728	5,341	418	19.1
	415.0(K-1)	4.67	-0.78	9,468	12,659	219	17.7		410.0(K-3)	2.92	-0.19	61,513	12,871	1,378	19.6

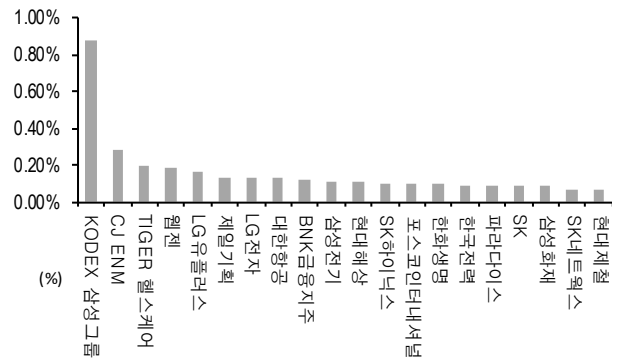
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,229,579	3,612.6	7,719,407	282,675	115,553	86,677	-205,920	-31.4	51.2	-22.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한국금융지주	85,900	-0.23	25.7	77.8	22,136	2,608	0.06%	1,613	133	-1,746	-2,745	-652
삼성전기	188,500	0.80	65.4	73.1	27,618	1,463	0.11%	301	1,087	-1,387	-1,139	-705
하나금융지주	42,850	3.63	52.3	70.0	165,610	-1,889	0.07%	10,366	-4,497	-4,561	-6,587	-1,195
삼성전자	81,500	-0.85	937.3	67.2	1,410,016	9,690	0.04%	-16,719	56,593	-42,271	-41,944	-3,450
NAVER	377,500	0.40	131.7	61.9	50,211	-9,012	0.04%	378	368	-814	-762	-216
SK 텔레콤	275,000	2.61	74.3	59.3	23,548	-793	0.04%	252	-351	79	353	-225
기아차	82,900	-1.66	154.8	59.1	128,548	-1,624	-0.03%	-5,769	2,753	2,636	2,004	-1,873
LG 전자	149,500	-1.64	171.5	55.4	70,720	1,180	0.13%	-5,709	-5,809	11,445	-3	140
삼성 SDI	663,000	-0.90	112.6	55.3	24,321	-1,260	0.05%	-755	-525	1,286	-45	1,371
호텔신라	87,000	0.46	25.4	54.9	43,350	38	-0.02%	-1,863	482	1,381	1,385	-4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터