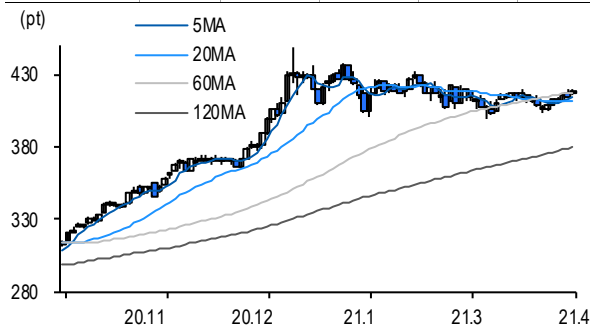


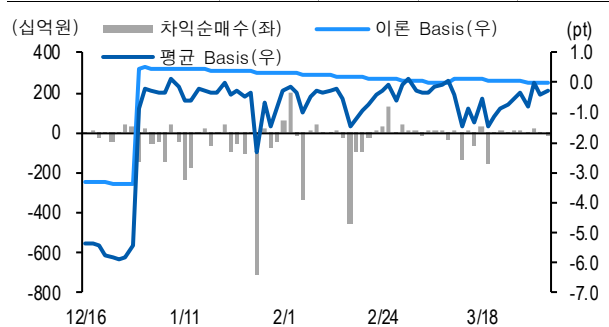
선물옵션시장 지표

2021.4.2

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	419.42	1.06	4.38	9,947.1	-
선물 6월물	419.20	1.10	4.55	21,205.7	227,694
선물 9월물	418.75	1.09	4.50	12.5	3,404
4월물(mini)	419.30	1.08	4.50	2,056.6	64,149
5월물(mini)	419.00	0.96	4.00	4.3	897



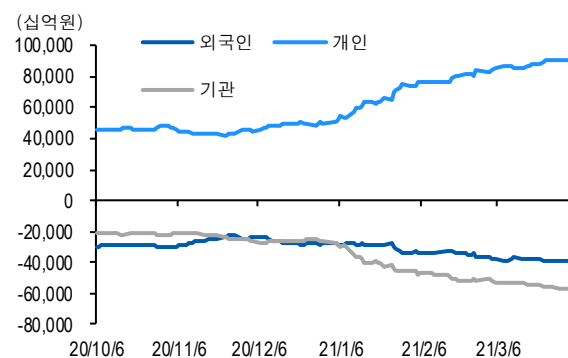
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.01	-0.24	-0.22	-0.06%
베이스(mini)	-0.55	-0.14	-0.12	0.10%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.42	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	-0.55	-0.16	-0.16	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	574.0	-10.0	564.0	-1.5	231.8	34.0	-4.8	3.3	-0.9	33.1
개인	-414.5	-34.7	-449.2	0.0	-0.7	-101.5	-28.2	-2.1	0.6	-1.2
기관	-161.7	45.5	-116.1	-17.7	-139.5	63.7	31.5	-1.3	0.6	-38.0
금융투자	-11.7	51.5	39.8	-5.0	-19.2	200.8	30.9	-1.2	0.9	-86.3
투신	-28.4	-2.3	-30.7	0.0	-8.0	-152.9	-0.1	-0.1	-0.3	36.1
은행+보험+기타금융	-32.4	-14.1	-46.5	0.0	-8.9	9.4	0.6	0.0	0.0	2.4
연기금+국가지자체	-101.9	1.0	-100.8	-12.7	-96.8	6.4	0.0	0.0	0.0	9.8
기타법인	2.2	-0.9	1.3	0.0	0.2	3.8	1.5	0.1	-0.4	6.1

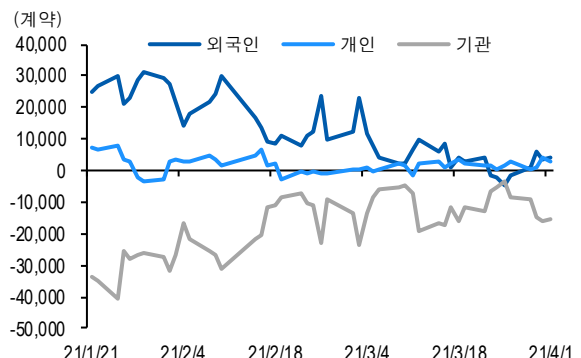
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

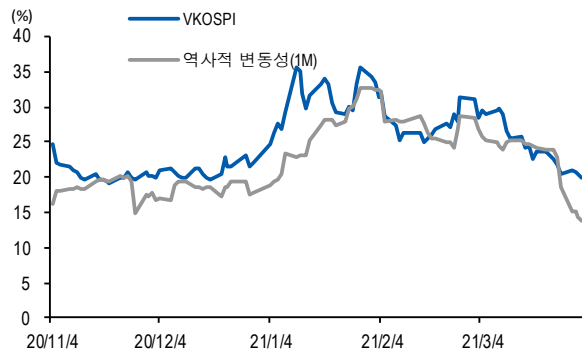
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	828,653	285.3	783,965	16.9%	지수옵션 전체	1,604,239	486.7	2,008,523
Put	775,586	201.4	1,224,558	19.5%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	19.88%(-0.56%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	2.87	0.99	69,610	10,993	310	16.9	Put	417.5(K+1)	3.53	-2.62	14,111	6,533	1,594	18.0
	420.0(K+2)	3.92	1.32	53,141	17,414	494	16.8		415.0(K+0)	2.62	-2.20	36,125	9,286	1,522	18.3
	417.5(K+1)	5.27	1.76	13,948	9,285	268	17.0		412.5(K-1)	1.95	-1.80	35,751	6,231	890	18.8
	415.0(K+0)	6.88	2.21	9,370	12,774	115	17.3		410.0(K-2)	1.46	-1.46	69,360	14,440	1,569	19.5
	412.5(K-1)	8.70	2.59	1,129	6,350	-93	17.7		407.5(K-3)	1.09	-1.20	52,209	9,844	1,591	20.2

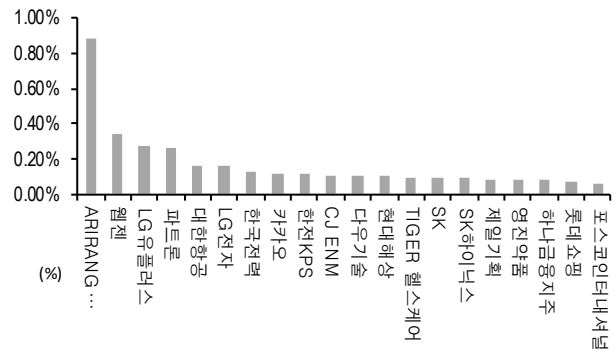
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,234,011	4,128.8	7,759,478	40,071	-96,531	30,323	60,944	33.1	-1.2	-38.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 텔레콤	277,000	0.73	63.5	67.8	22,834	-714	0.06%	916	-190	-726	-385	890
삼성전자	83,100	1.96	1,015.2	66.0	1,430,898	20,882	0.05%	9,923	41,164	-54,967	-49,996	-26,590
삼성 SDI	668,000	0.75	103.5	65.1	24,629	308	0.05%	25	347	-366	-472	-190
호텔신라	85,900	-1.26	36.2	64.7	35,629	-7,721	-0.07%	446	3,074	-4,160	5,918	1,107
한국금융지주	85,600	-0.35	12.1	63.9	20,421	-1,715	-0.02%	-851	482	369	532	781
삼성생명	77,500	-1.27	9.9	60.2	14,881	-1,770	-0.06%	-2,816	289	2,527	995	1,526
NAVER	378,000	0.13	119.4	58.1	49,765	-446	0.01%	-718	-207	910	-429	1,262
엔씨소프트	873,000	0.34	46.0	57.6	5,600	1,112	-0.32%	777	-522	-256	-24	117
카카오	499,500	1.94	117.1	57.2	31,263	1,192	0.12%	-171	848	-664	6	-2,845
기아차	83,500	0.72	111.0	56.4	123,530	-5,018	-0.01%	207	-7,012	6,755	377	5,406

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터