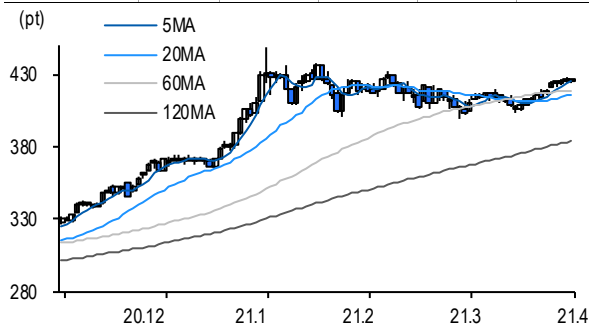


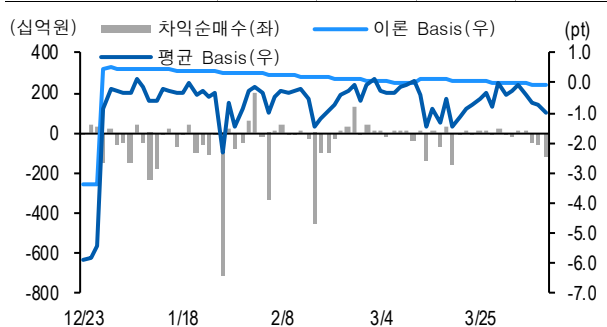
선물옵션시장 지표

2021.4.9

Market Data	(십억원, 계약)				
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	426.86	0.04	0.16	10,391.8	-
선물 6월물	424.50	-0.24	-1.00	20,953.0	232,313
선물 9월물	424.15	-0.21	-0.90	10.3	3,646
4월물(mini)	426.78	0.20	0.84	1,236.7	0
5월물(mini)	424.56	-0.28	-1.20	850.1	9,752



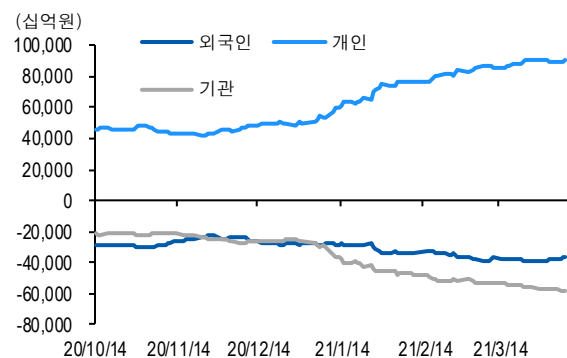
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.06	-1.03	-2.36	-0.23%
베이스(mini)	-0.61	-0.39	-0.08	0.05%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.48	-0.50	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-0.61	-0.06	-0.06	0.13%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	108.4	4.9	113.3	-2.7	150.1	-118.5	-190.7	-2.6	1.8	-33.2
개인	362.7	-40.2	322.5	0.0	-0.9	277.1	35.6	2.4	-1.7	69.2
기관	-481.1	51.8	-429.3	-113.7	-141.3	-130.6	149.0	1.8	0.2	-36.2
금융투자	-350.1	23.3	-326.8	-111.6	-102.7	14.3	145.7	2.7	0.4	-82.4
투신	2.3	0.9	3.2	0.0	21.0	-166.0	0.1	-1.0	0.1	80.3
은행+보험+기타금융	26.1	-3.3	22.8	0.0	19.2	-3.0	3.4	0.0	-0.3	3.2
연기금+국가자재	-147.7	-0.1	-147.8	-2.2	-60.0	24.2	-0.2	0.0	0.0	-37.2
기타법인	9.9	-16.5	-6.5	0.0	0.5	-28.0	6.1	-1.5	-0.2	0.2

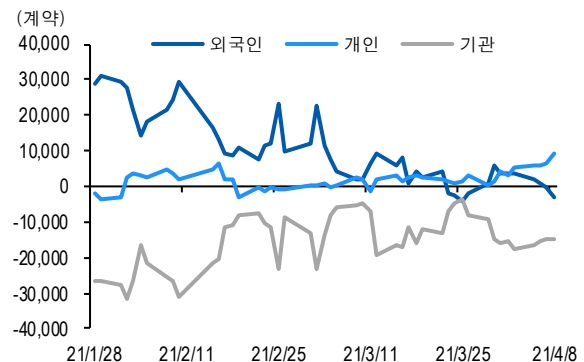
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



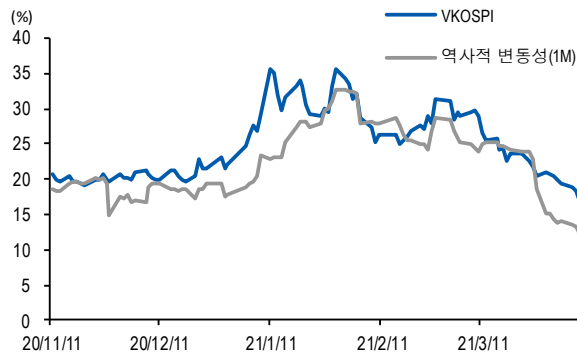
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,586,834	294.6	443,297	5.9%	지수옵션 전체	3,103,604	506.5	1,207,145
Put	1,516,770	211.9	763,848	9.0%	PCR(금액기준)	0.72	VKOSPI	16.19%(-1.26%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	0.01	-0.07	59,513	0	-32,636	15.2	Put	430.0(K+1)	3.26	-1.25	20,882	0	-3,108	11.2
	432.5(K+2)	0.01	-0.18	133,448	0	-19,623	11.0		427.5(K+0)	0.87	-1.76	139,197	0	-6,666	5.5
	430.0(K+1)	0.01	-0.50	288,379	0	-32,232	6.7		425.0(K-1)	0.03	-1.28	437,282	0	-15,050	5.4
	427.5(K+0)	0.17	-0.99	592,738	0	-18,317	4.6		422.5(K-2)	0.01	-0.56	329,710	0	-15,476	9.0
	425.0(K-1)	1.79	-0.56	292,962	0	-22,774	4.5		420.0(K-3)	0.01	-0.21	223,947	0	-22,069	13.3

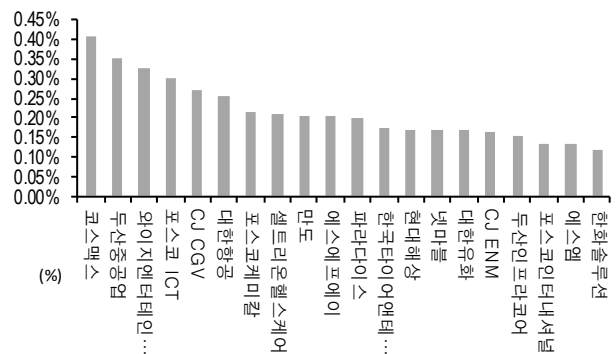
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	8,092,098	6,879.2	6,666,644	-1,831,856	-71,260	126,868	-55,130	-33.2	69.2	-36.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
DGB 금융지주	8,260	0.61	4.8	90.4	0	-47,445	0.05%	-3,261	255	3,006	4,645	-1,657
BNK 금융지주	6,760	-0.29	7.2	84.9	0	-80,951	0.00%	-8,350	2,514	5,836	-9,950	10,522
하나금융지주	41,700	-1.07	35.0	74.4	0	-91,089	-0.04%	-5,712	10,032	-4,559	-255	-777
SK 하이닉스	143,500	0.00	379.1	69.8	0	-259,539	-0.22%	-4,198	1,268	2,607	1,896	-582
LG 디스플레이	25,000	-2.34	84.8	60.3	0	-357,729	-0.02%	-2,848	12,542	-9,127	4,440	17,628
셀트리온	311,000	1.30	88.2	59.4	0	-25,344	0.00%	1,021	-2,939	1,914	-1,288	0
KB 금융	53,200	-0.37	31.8	52.2	0	-61,142	-0.08%	-1,696	2,417	-784	1,295	3,749
POSCO	333,000	1.06	63.3	49.0	0	-17,691	-0.11%	-303	281	14	-3,139	1,411
현대미포조선	65,800	0.00	8.9	47.8	0	-13,812	-0.12%	1,782	145	-1,926	-2,536	1,330
대한항공	27,250	0.18	28.4	40.7	0	-161,611	0.25%	2,001	-340	-876	3,875	-7,448

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터