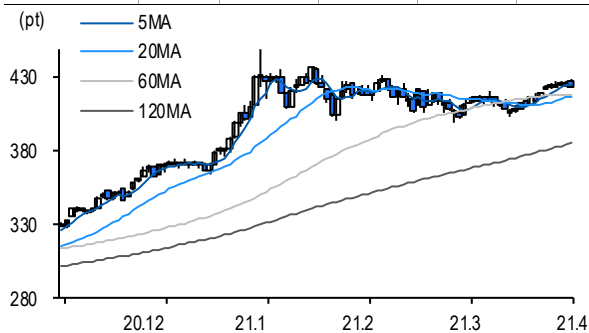


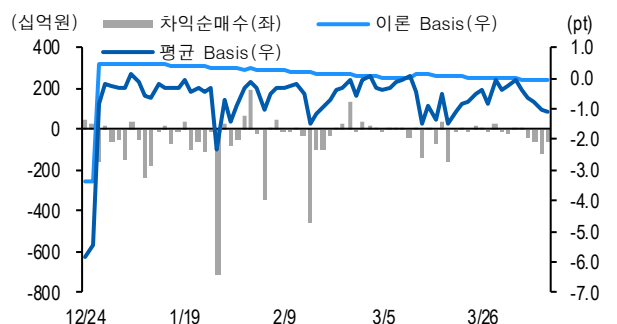
선물옵션시장 지표

2021.4.12

Market Data	(십억원, 계약)				
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.30	-0.60	-2.56	8,637.2	-
선물 6월물	423.25	-0.29	-1.25	24,757.7	234,168
선물 9월물	422.75	-0.33	-1.40	11.4	3,648
5월물(mini)	423.30	-0.30	-1.26	2,247.0	18,359
5월물(mini)	423.18	-0.31	-1.82	6.2	3,147



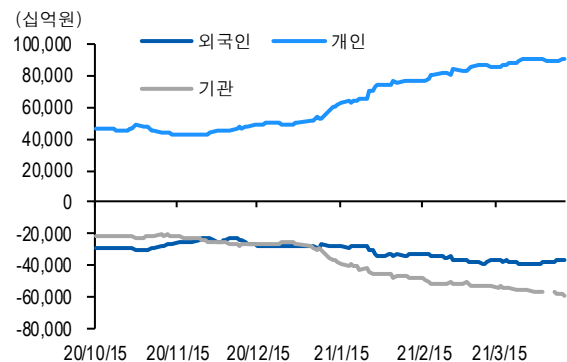
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.07	-1.09	-1.05	-0.24%
베이스(mini)	-0.62	-0.93	-1.00	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.50	-0.50	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	-0.62	-0.89	-0.89	-0.06%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-317.8	33.2	-284.6	-29.0	-168.5	-42.1	-8.1	-4.2	2.4	-36.2
개인	720.9	70.1	791.0	0.0	3.1	-310.4	6.5	1.1	0.0	96.7
기관	-412.8	-106.6	-519.4	-31.9	-246.1	382.8	1.0	3.8	-2.6	-68.4
금융투자	-295.2	-148.6	-443.8	-49.4	-113.0	506.9	1.7	4.4	-2.0	46.2
투신	1.0	0.7	1.7	-1.6	-4.6	-201.9	-0.7	-0.6	-0.6	-85.5
은행+보험+기타금융	-34.9	15.2	-19.7	0.0	-22.9	77.7	0.0	0.0	0.1	0.6
연기금+국가자재	-67.7	5.8	-61.9	19.1	-91.5	0.1	0.1	0.0	0.0	-29.7
기타법인	9.7	3.2	12.9	0.0	0.3	-30.3	0.6	-0.8	0.1	8.0

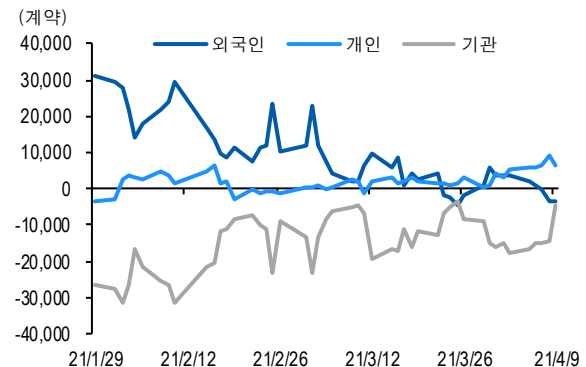
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	350,946	152.1	489,388	13.8%	지수옵션 전체	836,116	338.9	1,323,613
Put	485,170	186.8	834,225	15.9%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	16.69%(+0.50%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	3.30	-0.37	15,596	4,819	2,228	13.9	Put	430.0(K+1)	11.45	1.20	282	302	74	16.1
	432.5(K+2)	3.98	-0.44	5,747	2,288	1,016	13.7		427.5(K+0)	9.87	0.71	1,303	892	510	15.9
	430.0(K+1)	4.80	-0.43	8,086	4,137	989	13.6		425.0(K-1)	8.52	0.64	6,849	3,500	1,798	15.9
	427.5(K+0)	5.78	-0.55	6,049	4,654	1,487	13.6		422.5(K-2)	7.31	0.64	3,771	2,577	1,110	15.9
	425.0(K-1)	6.90	-0.63	3,746	4,562	1,183	13.5		420.0(K-3)	6.25	0.58	5,597	2,898	844	16.0

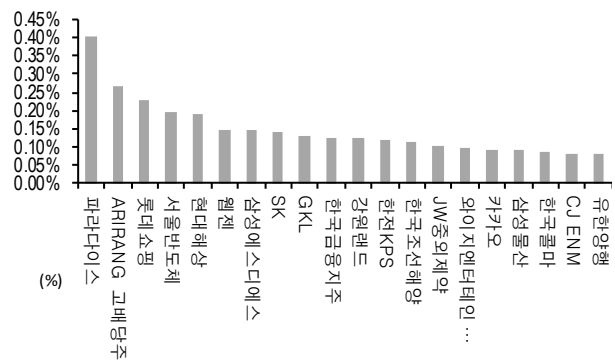
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선물배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	3,856,952	3,553.2	6,733,956	67,312	-59,076	125,414	-70,538	-36.2	96.7	-68.4	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선물배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	41,200	-1.32	31.9	92.2	164,686	-14,689	-0.07%	-136	1,717	-1,995	9,871	5,506
DGB 금융지주	8,210	-0.36	4.4	90.0	24,879	-23,014	-0.15%	-1,534	2,384	-850	25,016	0
한국금융지주	100,000	1.01	47.9	79.0	83,171	5,891	0.13%	1,893	170	-2,063	-3,316	-2,352
POSCO	327,500	-1.36	65.3	77.5	20,835	1,940	-0.07%	-668	317	350	-1,599	665
삼성전자	83,600	-1.30	1,107.0	73.6	1,502,875	-107,917	-0.18%	10,816	-15,192	4,209	53,060	9,901
KB 금융	52,600	-0.57	33.7	68.5	54,275	-13,690	-0.29%	-3,966	24	3,956	16,326	1,725
삼성증권	41,950	-0.12	13.7	68.0	68,520	9,523	0.04%	-2,398	10,506	-8,240	-5,501	-2,696
SK	293,500	4.82	136.3	67.4	24,494	18,453	0.14%	739	1,962	-2,806	-9,769	-7,977
호텔신라	85,200	-0.23	14.6	66.6	29,762	-135	-0.07%	-809	1,018	-219	878	1,867
삼성생명	76,500	-1.29	13.0	66.5	24,065	4,053	-0.35%	-1,036	3,630	-2,621	692	130

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터