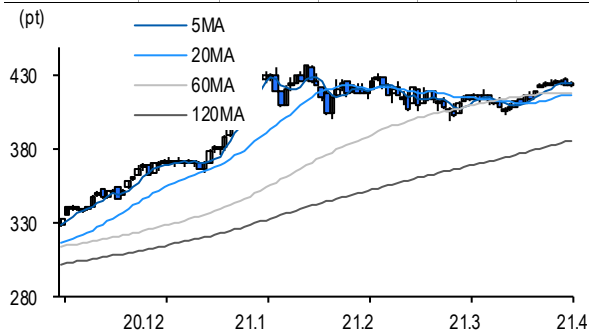


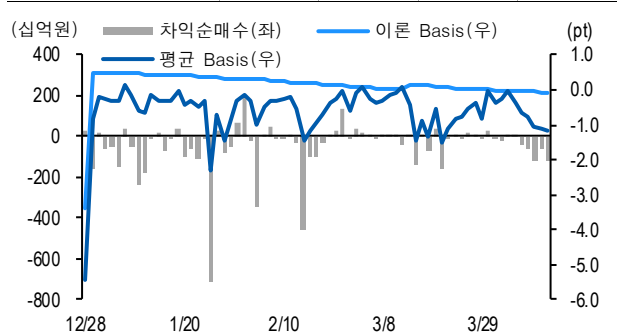
선물옵션시장 지표

2021.4.13

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.22	-0.02	-0.08	8,413.9	-
선물 6월물	423.50	0.06	0.25	18,473.4	235,345
선물 9월물	423.05	0.07	0.30	4.3	3,678
4월물(mini)	423.62	0.08	0.32	1,779.3	24,518
5월물(mini)	423.16	-0.02	-0.02	4.9	3,381



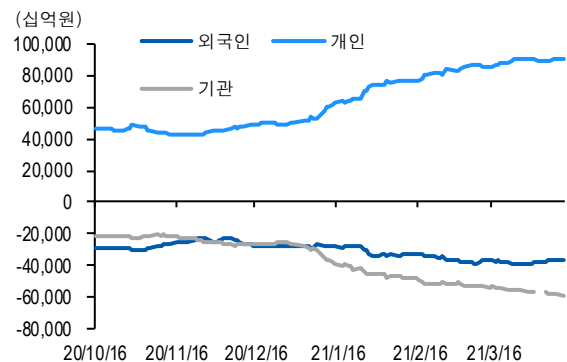
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.10	-1.17	-0.72	-0.25%
베이스(mini)	-0.64	-1.03	-0.60	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.55	-0.55	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.64	-0.58	-0.58	0.02%



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+국가지자체	-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

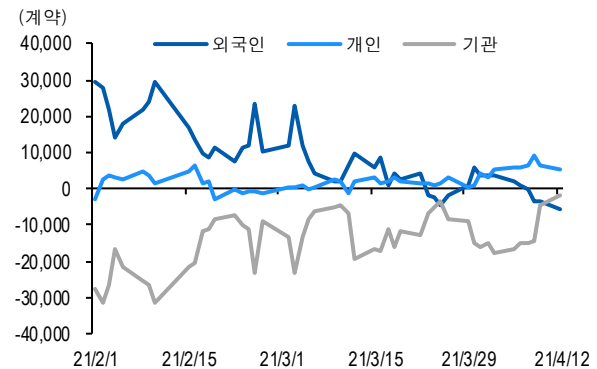
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	317,393	132.7	514,566	13.7%	지수옵션 전체	699,743	281.1	1,406,935
Put	382,350	148.4	892,369	15.6%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	16.54%(-0.15%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	432.5(K+3)	3.67	-0.31	9,240	2,900	612	13.7	Put	427.5(K+1)	9.38	-0.49	418	958	66	15.5
	430.0(K+2)	4.49	-0.31	8,039	4,440	303	13.7		425.0(K+0)	7.91	-0.61	2,875	3,888	388	15.3
	427.5(K+1)	5.44	-0.34	4,152	5,202	548	13.6		422.5(K-1)	6.71	-0.60	3,792	3,214	637	15.3
	425.0(K+0)	6.55	-0.35	6,458	5,736	1,174	13.6		420.0(K-2)	5.66	-0.59	6,375	4,148	1,250	15.4
	422.5(K-1)	7.85	-0.33	2,253	1,345	671	13.6		417.5(K-3)	4.80	-0.52	3,610	2,326	257	15.7

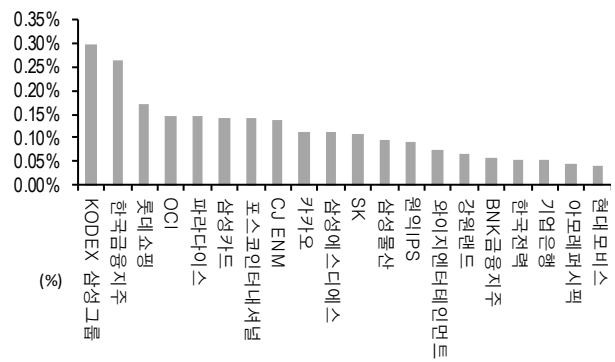
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,077,807	3,344.3	6,796,939	62,983	3,534	42,845	-48,614	1.5	10.2	-13.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	41,400	0.49	31.6	92.6	158,368	-6,318	-0.01%	6,930	-13,712	6,746	4,682	-495
POSCO	329,000	0.46	91.3	80.1	20,332	-503	-0.18%	-1,047	199	857	1,467	604
SK 텔레콤	281,500	1.81	53.8	79.3	16,381	3,194	-0.53%	1,368	-57	-1,311	2,567	496
기아	84,500	0.00	95.8	70.4	124,374	475	-0.09%	6,147	-634	-5,890	3,320	-2,554
삼성전자	83,300	-0.36	725.4	67.9	1,515,957	13,082	-0.09%	14,032	4,671	-18,724	-2,486	-19,200
LG 디스플레이	24,400	-2.98	57.6	60.8	716,035	-26,555	-1.62%	-11,599	9,448	2,101	6,218	8,769
엔씨소프트	906,000	-1.84	32.8	60.4	3,415	-101	-0.08%	-158	221	-66	-80	21
SK 하이닉스	137,500	-1.79	317.6	59.8	307,280	-5,970	-0.03%	-813	6,264	-5,502	8,845	180
NAVER	385,000	0.52	150.4	57.7	55,132	-141	-0.02%	54	619	-697	-1,935	1,238
호텔신라	85,500	0.35	13.2	57.3	30,790	1,028	-0.01%	1,693	-356	-1,337	86	-1,493

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터