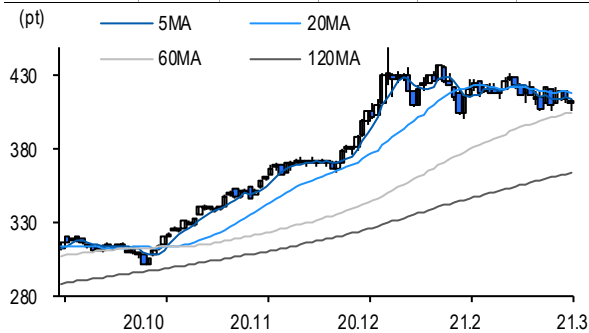


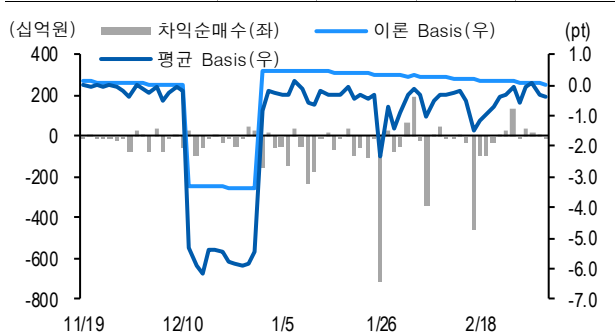
선물옵션시장 지표

2021.3.8

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.00	-0.52	-2.17	12,465.4	-
선물 3월물	411.75	-0.39	-1.60	33,785.3	233,898
선물 6월물	410.90	-0.48	-2.00	509.6	43,291
3월물(mini)	411.70	-0.40	-1.88	4,457.7	97,413
4월물(mini)	411.20	-0.42	-1.72	52.0	15,142



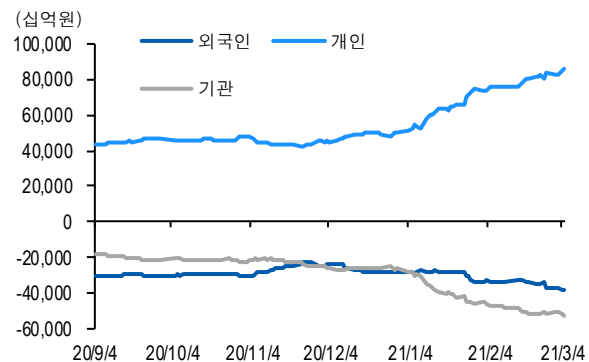
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.05	-0.35	-0.25	-0.10%
베이스(mini)	0.05	-0.35	-0.30	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.66	-0.65	-0.20%
합성선물 베이스(ATM)	0.05	-0.21	-0.21	-0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-369.0	-4.7	-373.7	-4.1	-239.5	56.4	-463.3	-0.4	7.4	34.5
개인	1,189.3	-20.1	1,169.1	0.0	-2.8	-159.6	18.6	-1.4	0.6	-106.5
기관	-804.8	35.6	-769.3	-10.2	-82.1	99.4	443.3	3.4	-4.4	78.5
금융투자	-518.6	21.1	-497.4	0.0	-3.4	131.4	442.7	1.3	-2.0	90.6
투신	-40.7	11.0	-29.7	0.0	-3.3	-5.7	0.5	0.0	0.0	4.4
은행+보험+기타금융	-15.0	-4.5	-19.5	0.0	-10.0	-42.1	0.0	2.1	-2.5	1.4
연기금+국가지자체	-195.4	5.4	-190.0	-10.2	-66.1	15.7	0.0	0.0	0.0	-17.9
기타법인	-15.5	-10.7	-26.2	0.0	-0.2	3.8	1.4	-1.6	-3.6	-6.5

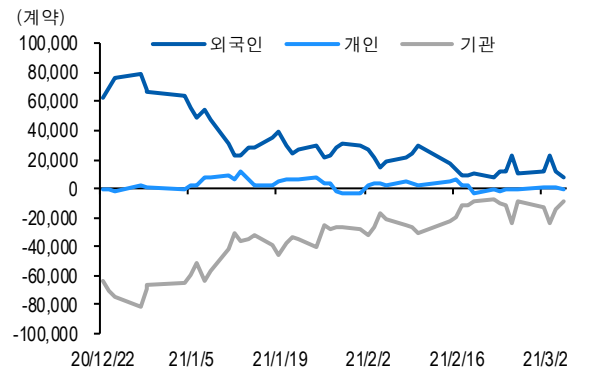
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



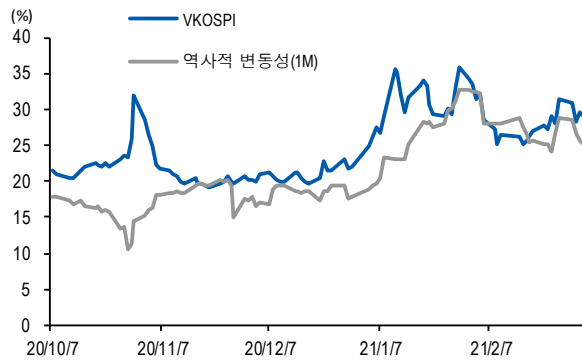
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,717,532	516.3	776,567	23.2%	지수옵션 전체	3,165,445	1,030.3	2,293,149
Put	1,447,913	514.0	1,516,582	27.0%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	29.09%(-0.41%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	1.60	-1.20	132,124	7,524	2,528	22.8	Put	417.5(K+1)	8.78	0.06	766	3,156	35	24.7
	420.0(K+2)	2.25	-1.35	165,053	11,183	2,788	23.1		415.0(K+0)	7.33	-0.02	2,561	4,722	-315	25.1
	417.5(K+1)	3.08	-1.49	77,160	4,476	255	23.4		412.5(K-1)	6.07	-0.17	2,764	3,459	388	25.7
	415.0(K+0)	4.12	-1.62	66,157	4,553	58	23.9		410.0(K-2)	5.01	-0.17	14,979	6,617	796	26.4
	412.5(K-1)	5.37	-1.72	23,777	3,779	869	24.5		407.5(K-3)	4.12	-0.25	22,524	7,930	-214	27.1

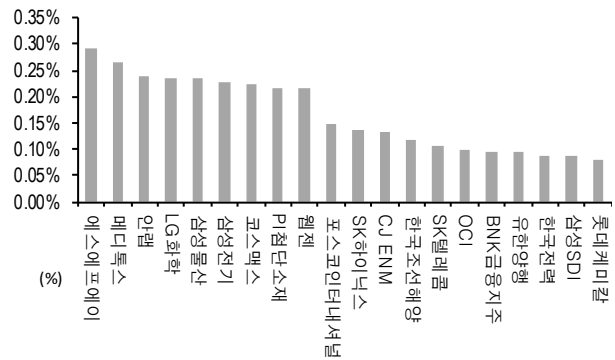
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,511,415	6,334.3	7,039,530	-66,381	21,411	-182,239	163,349	34.5	-106.5	78.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	322,500	0.47	97.8	111.3	19,621	577	0.08%	89	691	-784	88	-872
하나금융지주	38,550	-0.39	98.7	87.4	107,453	-44,140	-0.03%	-5,588	1,949	2,778	14,158	1,284
삼성전기	195,500	0.51	84.8	86.2	38,393	-417	0.23%	1,063	-196	-867	-555	-1,118
SK 하이닉스	140,500	-1.40	721.8	85.8	414,633	-25,904	0.14%	-2,665	6,959	-4,280	1,434	5,782
삼성전자	82,200	-0.24	1,384.2	83.0	1,160,377	-92,043	0.01%	-1,246	-45,509	46,847	7,058	-1,757
JW 중외제약	29,400	1.20	0.8	82.8	1,836	70	-0.22%	-121	151	-30	-31	1
호텔신라	83,700	-1.18	28.0	81.8	27,419	-4,213	0.03%	-3,416	3,455	-39	-57	58
NAVER	376,500	-3.83	474.9	80.0	44,686	-30,201	-0.26%	3,561	-19,575	17,255	18,328	1,773
LG 화학	909,000	4.72	364.3	75.1	17,403	737	0.24%	760	-334	-424	-829	-1,848
삼성 SDI	672,000	-0.88	210.6	73.9	21,851	-217	0.09%	611	864	-1,475	-474	-1,410

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터