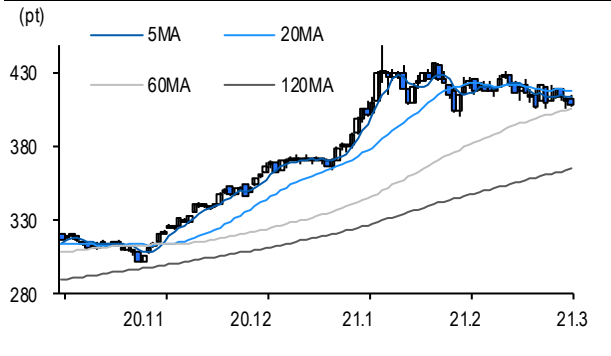


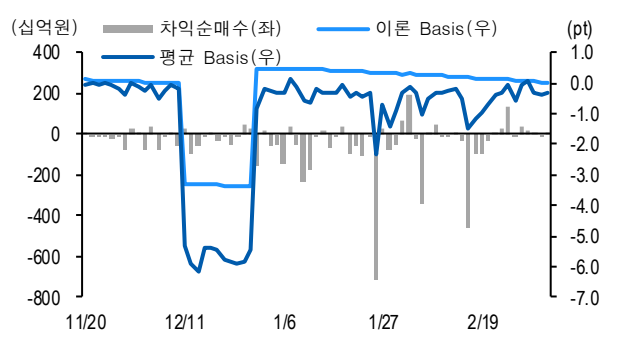


선물옵션시장 지표 2021.3.9

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	408.34	-0.89	-3.66	10,363.2	-
선물 3월물	408.20	-0.86	-3.55	27,064.4	207,386
선물 6월물	407.65	-0.79	-3.25	914.0	87,573
3월물(mini)	408.38	-0.82	-3.32	3,997.4	96,056
4월물(mini)	407.72	-0.85	-3.48	69.6	15,153

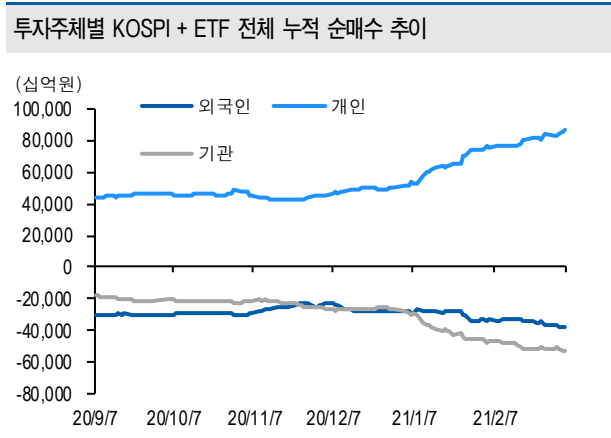


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.02	-0.32	-0.14	-0.08%	
베이스(mini)	0.02	-0.31	0.04	-0.08%	
제1스프레드(SP)	0.15	-0.83	-0.85	-0.24%	
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.10	-0.10	-0.03%	

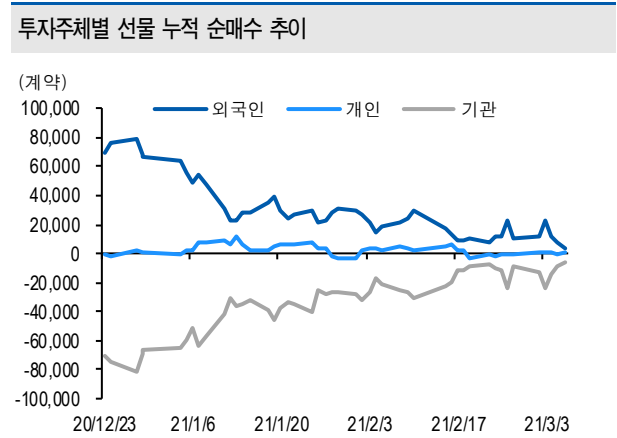


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-125.8	-27.0	-152.7	0.0	-198.0	-291.3	-68.4	10.0	6.8	10.3
개인	525.4	105.0	630.4	0.0	3.1	60.8	19.4	-5.0	-3.1	-87.2
기관	-377.4	-71.0	-448.4	2.0	-134.4	187.5	44.5	2.1	-1.5	79.9
금융투자	-87.4	-74.4	-161.8	0.0	-5.0	71.6	44.4	3.0	-1.3	116.8
투신	7.4	-21.7	-14.4	0.0	3.0	102.4	0.1	-0.7	-0.5	-78.1
은행+보험+기타금융	-6.6	25.0	18.4	0.0	-5.2	16.0	0.0	-0.2	0.3	-0.7
연기금+국가자재	-272.8	-0.8	-273.6	2.0	-139.2	-2.6	0.0	0.0	0.0	41.9
기타법인	-22.2	-7.0	-29.3	0.0	-0.7	43.0	4.5	-7.1	-2.3	-3.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,599,061	399.9	824,307	27.2%	지수옵션 전체	3,682,049	917.3	2,396,825
Put	2,082,988	517.4	1,572,518	30.1%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	29.48%(+0.39%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	0.99	-1.26	167,811	16,667	5,484	27.0	Put	415.0(K+1)	8.86	1.53	9,494	4,811	89	28.2
	417.5(K+2)	1.47	-1.61	76,900	5,769	1,293	27.2		412.5(K+0)	7.24	1.17	17,487	3,591	132	28.6
	415.0(K+1)	2.13	-1.99	69,707	7,348	2,795	27.5		410.0(K-1)	5.83	0.82	41,397	7,019	402	29.1
	412.5(K+0)	2.98	-2.39	37,601	5,196	1,417	27.8		407.5(K-2)	4.62	0.50	56,904	7,662	-268	29.6
	410.0(K-1)	4.06	-2.73	10,309	8,604	1,621	28.3		405.0(K-3)	3.65	0.27	83,235	7,256	708	30.4

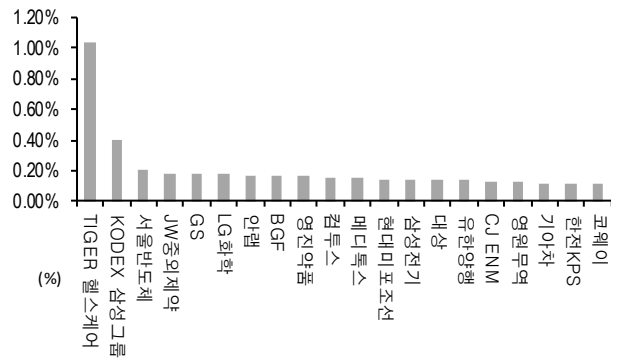
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,273,485	5,268.9	7,022,568	-16,962	38,405	-68,576	37,021	10.3	-87.2	79.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	309,000	-4.19	97.1	90.6	17,999	-1,622	0.07%	-141	-202	681	-436	1,383
삼성전기	188,000	-3.84	80.1	85.8	33,991	-4,402	0.14%	-410	338	52	772	2,360
삼성전자	81,900	-0.36	1,150.3	83.3	1,016,831	-143,546	-0.01%	5,787	-61,826	56,240	40,607	22,473
SK 하이닉스	135,500	-3.56	599.8	78.1	376,087	-38,546	0.10%	3,873	1,117	-4,939	13,805	6,507
현대차	230,500	-2.33	151.1	76.8	66,179	-3,105	-0.07%	-638	362	276	2,934	928
하나금융지주	40,050	3.89	85.9	76.8	99,200	-8,253	0.06%	17,685	-2,437	-13,616	-14,506	-4,762
NAVER	368,000	-2.26	290.7	75.4	36,070	-8,616	-0.15%	1,084	-1,119	71	2,930	41
호텔신라	82,700	-1.19	28.7	75.2	28,842	1,423	0.09%	-1,282	-413	1,700	-53	-1,071
POSCO	320,500	2.07	241.9	74.0	8,624	-585	-0.09%	1,596	-1,138	-457	-225	-451
LG 화학	888,000	-2.31	191.4	74.0	15,924	-1,479	0.18%	-1,159	-548	1,685	254	1,134

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터