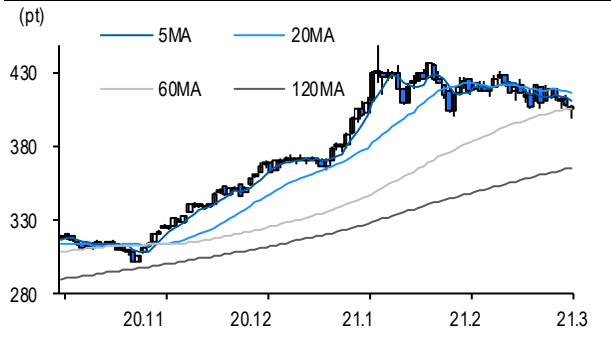
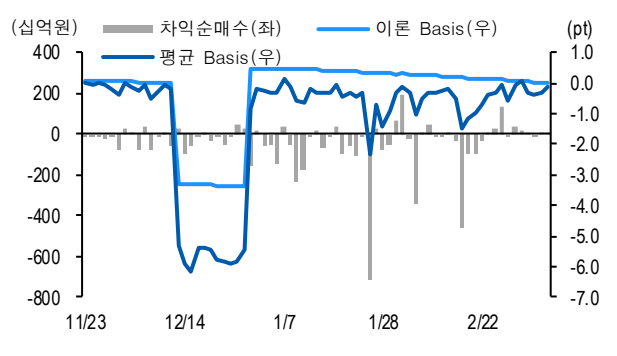


선물옵션시장 지표 2021.3.10

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	405.79	-0.62	-2.55	13,879.0	-	
선물 3월물	404.60	-0.88	-3.60	33,774.7	153,962	
선물 6월물	403.80	-0.94	-3.85	1,987.0	152,366	
3월물(mini)	404.48	-0.91	-3.90	6,434.1	98,370	
4월물(mini)	404.10	-0.89	-3.62	61.1	15,118	

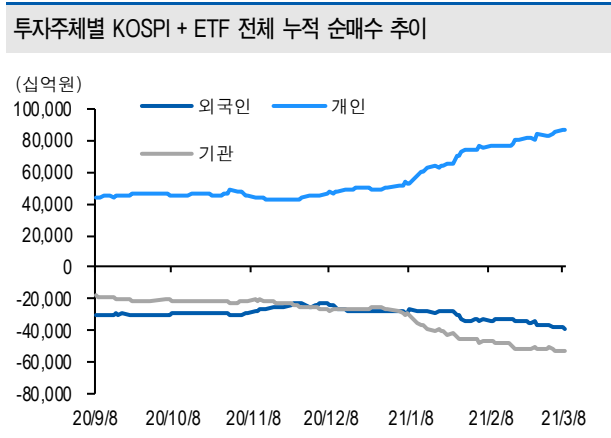


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.02	-0.12	-1.19	-0.03%	
베이스스(mini)	0.02	-0.13	-1.31	-0.04%	
제1스프레드(SP)	0.15	-0.79	-0.80	-0.23%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	-1.10	-1.10	-0.28%	

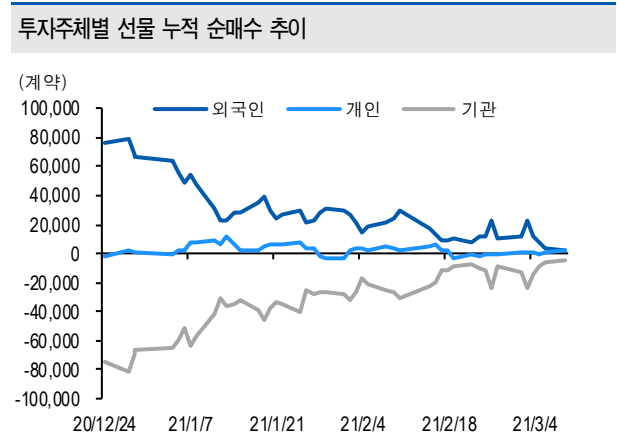


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-649.7	-23.3	-672.9	2.2	-197.4	-490.5	266.6	-0.1	5.3	52.2	
개인	359.0	-71.0	288.0	0.0	-1.7	177.1	15.0	-2.5	-0.9	13.0	
기관	291.9	93.9	385.7	0.0	-30.4	350.6	-270.4	3.6	-4.5	-63.8	
금융투자	351.2	5.9	357.1	0.0	-15.1	159.9	-271.7	4.9	-4.3	12.6	
투신	-5.8	34.4	28.6	0.0	-8.2	136.9	1.0	-1.3	-0.5	-20.8	
은행+보험+기타금융	19.2	24.4	43.5	0.0	2.2	51.9	0.3	0.0	0.4	-1.8	
연기금+국가자재	-41.8	30.9	-10.9	0.0	-11.7	1.9	0.0	0.0	0.0	-53.8	
기타법인	-1.2	0.4	-0.7	0.0	-0.5	-37.2	-11.2	-1.0	0.1	-1.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,258,866	564.9	906,489	26.6%	지수옵션 전체	4,728,194	1,262.8	2,504,545
Put	2,469,328	697.9	1,598,056	34.1%	PCR(금액기준)	1.24	VKOSPI	29.78%(+0.30%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	415.0(K+3)	0.98	-1.15	263,435	10,983	3,635	27.0	Put	410.0(K+1)	7.47	1.64	5,111	6,684	-335	34.6
	412.5(K+2)	1.44	-1.54	219,185	7,315	2,119	26.4		407.5(K+0)	5.88	1.26	7,722	7,931	269	33.9
	410.0(K+1)	2.13	-1.93	149,904	11,083	2,479	26.2		405.0(K-1)	4.55	0.90	41,655	7,445	189	33.7
	407.5(K+0)	3.07	-2.29	88,204	13,859	2,282	26.2		402.5(K-2)	3.46	0.60	65,331	11,854	84	33.8
	405.0(K-1)	4.20	-2.71	36,709	6,336	3,864	25.8		400.0(K-3)	2.60	0.36	125,854	17,886	821	34.2

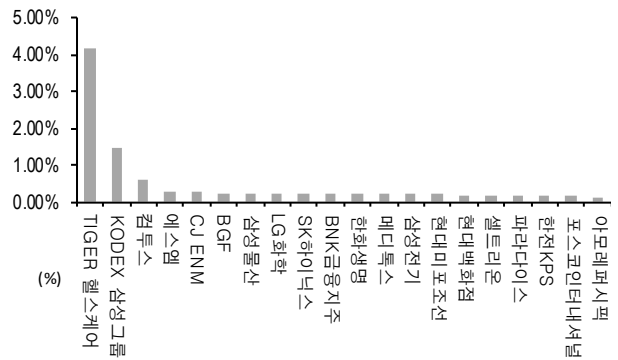
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	7,255,845	7,164.2	7,170,840	148,272	66,066	-38,779	-29,503	52.2	13.0	-63.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	320,000	3.56	142.2	111.0	13,796	-4,203	0.05%	635	-133	-372	-791	1,006
하나금융지주	40,800	1.87	124.4	89.3	61,493	-37,707	-0.02%	-15,131	-2,114	18,395	26,734	6,016
POSCO	317,500	-0.94	326.7	84.5	9,845	1,221	-0.22%	-3,281	-786	4,072	1,705	926
삼성전기	184,000	-2.13	129.8	82.2	26,123	-7,868	0.20%	62	7,122	-7,136	-299	-2,725
한화솔루션	41,200	-3.40	80.6	79.4	45,038	-12,199	-0.07%	1,533	310	-1,844	-3,086	-1,827
호텔신라	84,100	1.69	55.3	78.4	28,866	24	0.07%	-1,711	-34	1,655	-577	98
SK 하이닉스	136,500	0.74	800.3	77.2	374,885	-1,202	0.21%	4,906	-5,925	1,044	-5,068	-2,499
LG 이노텍	207,000	-1.19	40.6	77.1	19,837	-5,141	-0.05%	-1,857	-196	2,052	654	1,345
기아차	83,500	0.72	315.1	76.6	127,251	-7,324	0.03%	-3,612	735	3,363	-7,900	9,648
LG 디스플레이	22,050	0.92	44.9	73.3	436,180	-71,195	-0.71%	-1,552	-1,251	2,808	1,494	4,100

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터