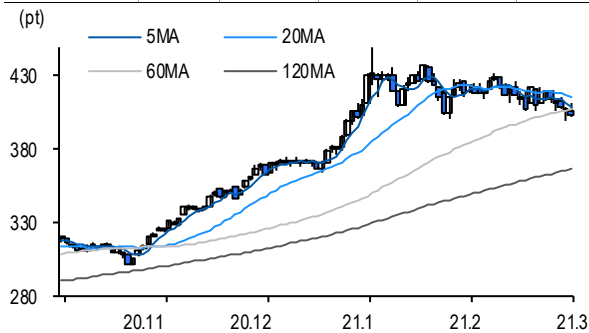


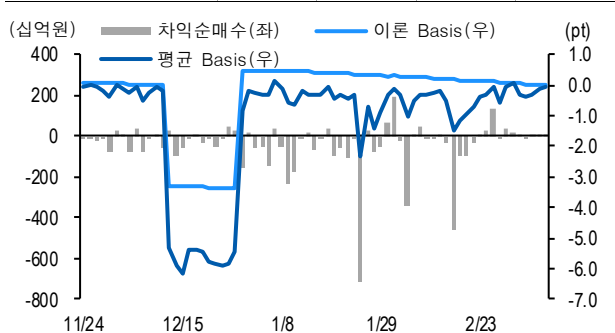
선물옵션시장 지표

2021.3.11

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	403.48	-0.57	-2.31	9,826.8	-
선물 3월물	403.50	-0.27	-1.10	26,775.4	98,235
선물 6월물	402.55	-0.31	-1.25	3,809.2	194,040
3월물(mini)	403.50	-0.27	-0.98	4,482.6	89,705
4월물(mini)	402.80	-0.32	-1.30	68.8	16,229



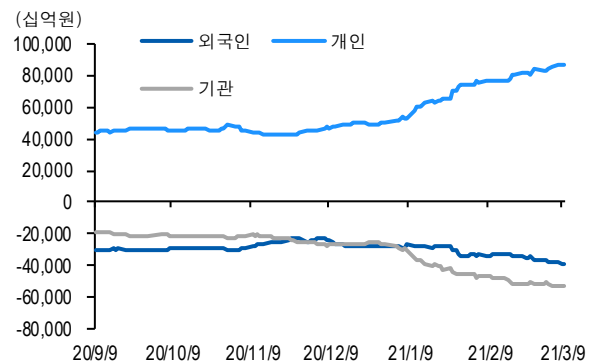
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.01	-0.07	0.02	-0.02%
베이스스(mini)	0.01	-0.07	0.02	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.82	-0.90	-0.23%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.10	0.10	0.02%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-5.7	2.4	-3.3	-1.4	31.0	-52.2	52.1	6.1	1.4	9.0
개인	405.8	12.0	417.8	0.0	1.7	-24.1	-30.4	-7.0	0.2	-1.3
기관	-408.5	-10.3	-418.7	4.1	-277.5	55.6	-18.1	-0.7	-1.4	-10.4
금융투자	-78.7	-9.5	-88.1	0.0	-5.1	-1.4	-18.4	-0.2	-1.3	1.3
투신	-22.3	-6.8	-29.2	2.0	-11.9	73.2	0.4	-0.2	0.0	1.8
은행+보험+기타금융	-33.3	8.4	-25.0	0.0	-16.3	-6.4	-0.1	-0.2	-0.1	-4.0
연기금+국가자재	-265.7	1.5	-264.2	2.0	-237.8	-9.8	0.0	0.0	0.0	-9.5
기타법인	8.3	-4.1	4.2	0.0	0.2	20.6	-3.6	1.6	-0.2	2.7

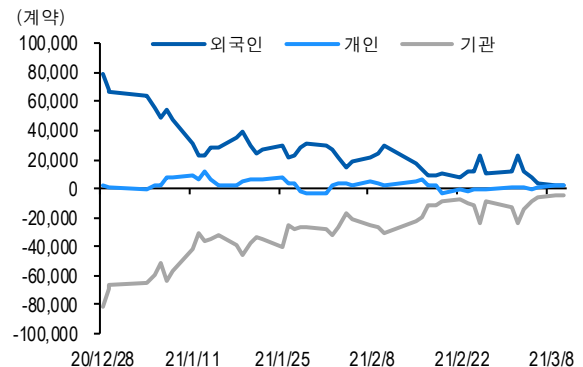
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



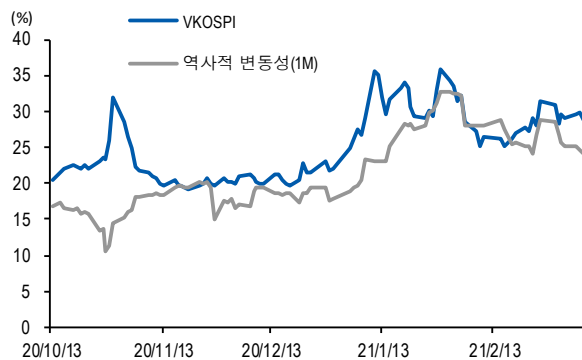
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,073,952	455.4	960,792	23.6%	지수옵션 전체	4,864,714	1,065.4	2,625,375
Put	2,790,762	610.1	1,664,583	26.1%	PCR(금액기준)	1.34	VKOSPI	28.85%(-0.93%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	412.5(K+3)	0.33	-1.11	225,545	12,565	5,250	23.2	Put	407.5(K+1)	5.25	-0.63	49,089	7,706	-225	23.4
	410.0(K+2)	0.71	-1.42	202,182	15,418	4,335	23.8		405.0(K+0)	3.69	-0.86	116,823	8,588	1,143	24.1
	407.5(K+1)	1.32	-1.75	105,449	15,326	1,467	24.1		402.5(K-1)	2.50	-0.96	192,351	13,541	1,687	25.0
	405.0(K+0)	2.27	-1.93	55,231	9,895	3,559	24.8		400.0(K-2)	1.63	-0.97	266,396	19,856	1,970	25.8
	402.5(K-1)	3.55	-2.06	13,889	3,764	1,579	25.4		397.5(K-3)	1.07	-0.87	199,114	11,232	562	27.2

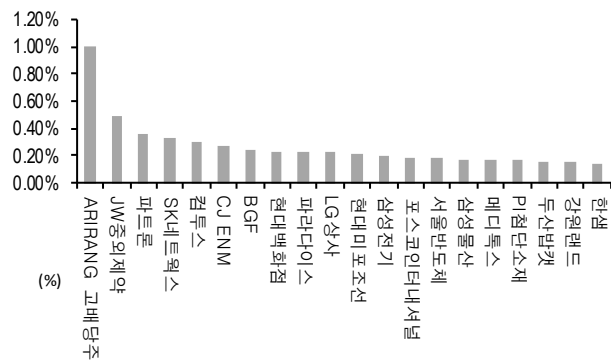
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,192,938	6,430.4	7,219,126	48,286	37,897	-20,078	-13,197	9.0	-1.3	-10.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	181,500	-1.36	91.1	99.7	22,676	-3,447	0.19%	1,419	-2,495	1,076	732	160
롯데케미칼	306,000	-4.38	97.5	98.8	11,386	-2,410	0.10%	-232	-242	903	-248	538
한국금융지주	82,900	-1.89	23.4	97.9	13,367	-9,623	-0.05%	1,006	-2,438	1,432	1,033	673
SK 텔레콤	250,500	1.01	59.7	91.5	16,271	-7,985	0.09%	2,336	-140	-2,137	-835	-1,303
SK 하이닉스	134,000	-1.83	689.8	91.0	329,047	-45,838	0.12%	-9,226	12,201	-3,172	10,589	-7,182
하나금융지주	40,500	-0.74	64.3	90.4	49,608	-11,885	0.00%	-2,913	-1,288	4,001	5,505	-1,251
삼성전자	80,800	-0.74	1,409.2	88.9	763,674	-160,843	0.03%	5,482	11,494	-19,783	-31,428	137
NAVER	372,000	2.90	308.7	87.7	30,679	-6,103	0.02%	-2,125	5,391	-3,595	-2,593	-4,259
LG 디스플레이	21,900	-0.68	34.9	83.7	326,003	-110,177	-0.16%	19,011	1,124	-20,125	-1,995	-7,080
LG 이노텍	210,500	1.69	62.0	75.9	21,584	1,747	0.12%	900	463	-1,385	-1,527	-2,033

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터