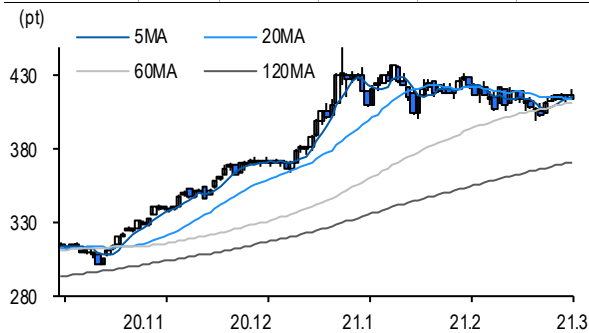


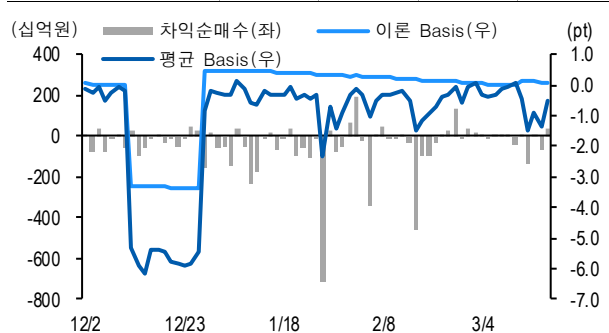
선물옵션시장 지표

2021.3.19

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	417.06	0.74	3.05	10,506.2	-
선물 6월물	416.95	1.01	4.15	23,222.4	223,381
선물 9월물	416.40	0.99	4.10	13.9	3,079
4월물(mini)	416.98	0.98	4.04	2,369.0	30,459
5월물(mini)	416.70	0.93	3.84	3.1	349



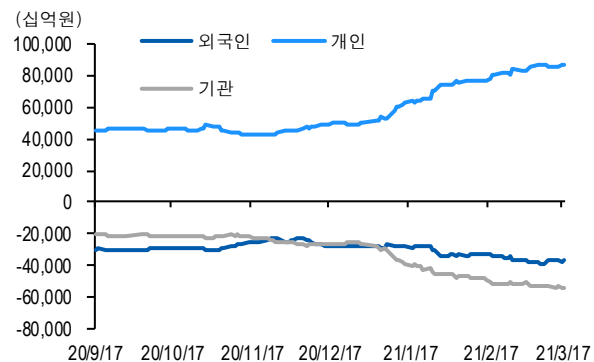
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.11	-0.53	-0.11	-0.15%
베이스(mini)	-0.43	-0.53	-0.08	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.62	-0.50	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	-0.43	-0.07	-0.07	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	480.9	19.9	500.8	33.4	294.1	361.7	-20.4	2.4	9.5	-14.6
개인	-616.5	13.5	-603.0	0.0	-1.5	84.6	22.5	-2.5	-2.5	134.8
기관	134.9	-33.0	101.9	-0.2	-256.3	-486.5	3.0	1.2	-7.2	-123.9
금융투자	334.3	7.0	341.3	-0.2	-7.5	-732.2	2.5	1.2	-7.5	-87.4
투신	-4.0	-22.9	-27.0	-2.1	-13.5	239.6	0.4	-0.1	0.3	20.6
은행+보험+기타금융	-25.7	-17.8	-43.5	0.0	-19.8	7.9	0.0	0.1	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-189.3	-0.2	-189.5	2.1	-216.7	-1.8	0.0	0.0	0.0	-57.1
기타법인	0.7	-0.5	0.2	0.0	-0.1	40.1	-5.2	-1.1	0.2	3.7

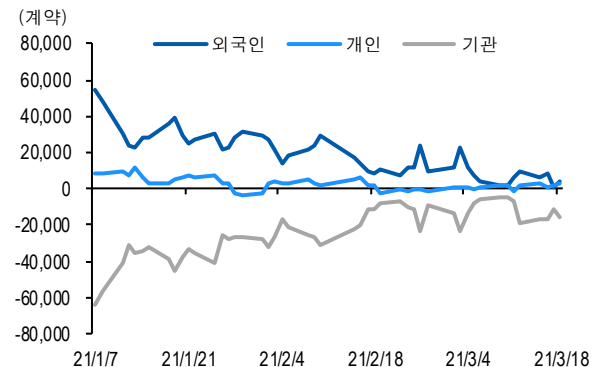
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	477,882	224.9	570,892	20.0%	지수옵션 전체	1,085,108	449.4	1,479,204
Put	607,226	224.5	908,312	20.6%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	22.69%(-1.84%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	5.60	0.65	7,046	3,026	655	20.0	Put	417.5(K+1)	8.38	-2.97	3,541	1,988	798	19.5
	420.0(K+2)	6.64	0.81	8,341	7,866	655	20.0		415.0(K+0)	7.24	-2.86	6,528	4,254	591	19.7
	417.5(K+1)	7.88	1.03	5,501	3,769	706	20.3		412.5(K-1)	6.22	-2.61	5,316	2,099	-83	20.0
	415.0(K+0)	9.23	1.24	3,428	3,327	78	20.6		410.0(K-2)	5.37	-2.38	10,202	5,970	284	20.4
	412.5(K-1)	10.40	1.13	829	1,905	-200	20.1		407.5(K-3)	4.64	-2.16	7,414	2,707	390	20.9

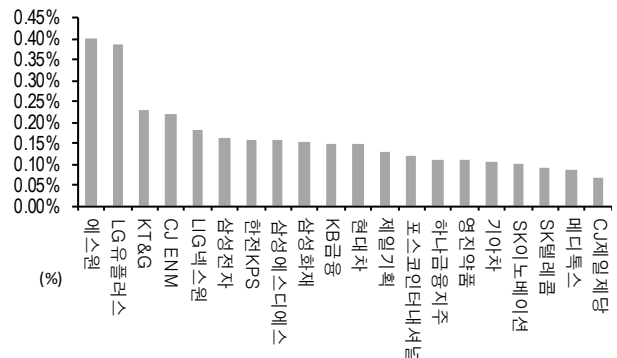
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,977,631	4,215.3	6,559,887	232,689	-33,114	116,209	-85,218	-14.6	134.8	-123.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	194,500	0.26	104.2	98.8	27,327	-9,105	-0.07%	-452	4,345	-3,891	2,914	1,706
하나금융지주	41,650	0.36	65.3	85.7	165,683	27,052	0.11%	3,368	-399	-2,696	-15,180	-14,794
삼성전자	82,800	0.85	1,230.2	80.4	1,458,318	53,839	0.16%	10,166	24,491	-35,365	-32,124	-28,635
엔씨소프트	942,000	0.43	39.1	61.1	2,518	7	-0.08%	-52	37	48	-44	57
SK 하이닉스	143,000	2.14	380.5	61.0	378,059	3,375	0.05%	-5,443	6,252	-1,560	-1,992	4,585
카카오	499,500	3.52	226.6	59.4	32,121	6,757	0.02%	1,128	4,695	-5,940	-1,049	-4,646
KB 금융	50,400	-0.59	71.4	58.8	92,499	22,465	0.15%	4,224	-2,728	-1,400	-10,332	-11,994
LG 이노텍	211,500	-2.08	27.2	57.9	22,132	-2,235	-0.08%	-1,589	345	1,244	759	3,022
호텔신라	87,400	0.34	26.5	57.0	50,473	-615	-0.03%	-2,118	-299	2,418	637	1,595
NAVER	404,500	5.61	411.3	57.0	66,964	16,816	-0.01%	730	11,595	-12,589	-9,265	-5,201

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터