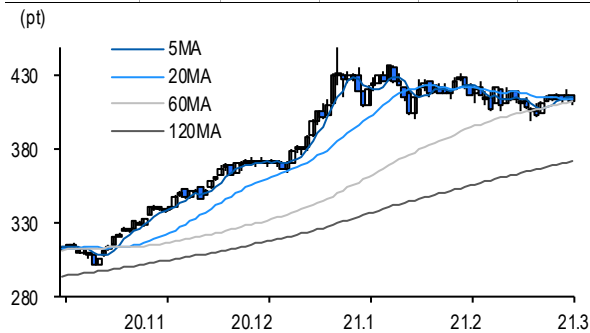


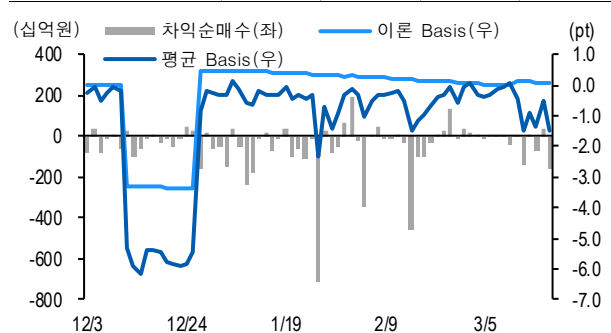
선물옵션시장 지표

2021.3.22

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.91	-1.00	-4.15	9,983.7	-
선물 6월물	410.75	-1.49	-6.20	24,092.2	224,645
선물 9월물	410.55	-1.40	-5.85	32.2	3,289
4월물(mini)	410.98	-1.44	-6.00	2,548.5	32,635
5월물(mini)	410.90	-1.39	-5.80	5.8	455



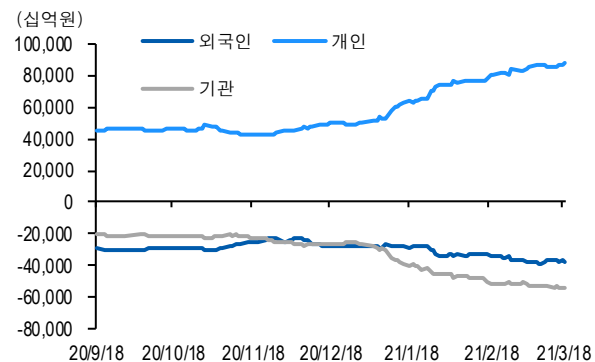
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.09	-1.49	-2.16	-0.38%
베이스스(mini)	-0.44	-1.30	-1.93	-0.21%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.50	-0.50	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.44	-1.94	-1.94	-0.36%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-582.1	-10.7	-592.9	-43.7	-96.3	-195.8	27.6	-3.1	3.1	-0.9
개인	1,604.4	37.4	1,641.8	0.0	1.5	-96.0	-3.1	2.0	2.0	-5.7
기관	-1,001.8	-29.4	-1,031.1	-116.5	-229.4	446.3	-29.3	0.4	-4.1	13.8
금융투자	-591.7	-68.2	-659.8	-100.1	-46.0	650.2	-29.5	0.2	-3.8	-6.9
투신	-124.5	-2.8	-127.3	0.0	-57.0	-262.4	0.1	-0.1	-0.3	-30.6
은행+보험+기타금융	-30.6	21.1	-9.4	0.0	-9.0	21.3	0.0	0.3	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-219.6	-2.4	-221.9	-16.4	-90.4	37.3	0.1	0.0	0.0	50.8
기타법인	-20.5	2.7	-17.8	0.0	-2.6	-154.5	4.8	0.7	-1.0	-7.1

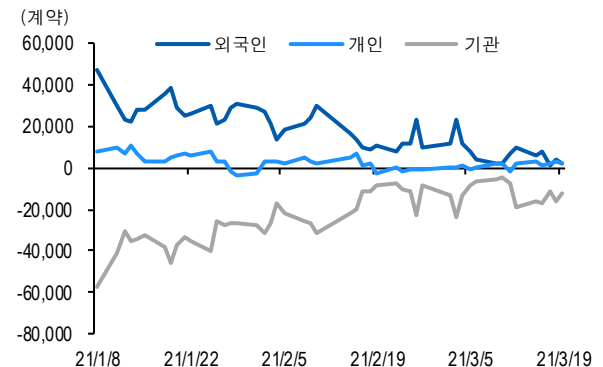
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	563,429	229.9	592,385	18.9%	지수옵션 전체	1,194,773	487.3	1,550,011
Put	631,344	257.4	957,626	22.7%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	23.61%(+0.92%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	2.92	-1.74	30,416	5,946	1,540	19.0	Put	420.0(K+1)	13.05	3.38	491	4,028	-49	22.1
	422.5(K+2)	3.57	-2.03	13,976	3,634	608	18.9		417.5(K+0)	11.75	3.37	957	1,967	-21	22.7
	420.0(K+1)	4.33	-2.31	13,685	8,995	1,129	18.8		415.0(K-1)	10.30	3.06	1,715	4,035	-219	22.7
	417.5(K+0)	5.22	-2.66	8,508	4,322	553	18.8		412.5(K-2)	8.94	2.72	1,813	2,283	184	22.6
	415.0(K-1)	6.26	-2.97	7,727	3,277	-50	18.8		410.0(K-3)	7.76	2.39	6,347	6,373	403	22.7

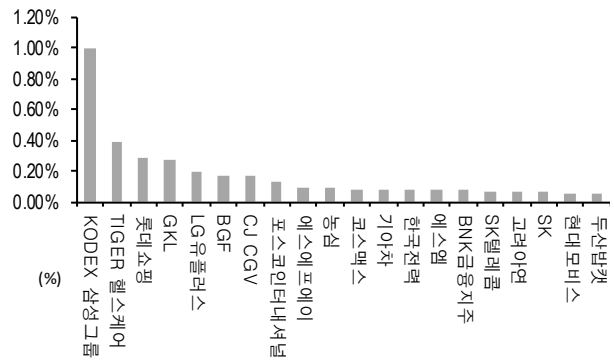
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,463,231	3,595.1	6,618,543	58,656	1,536	-32,387	36,924	-0.9	-5.7	13.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	492,500	-1.40	248.7	98.5	30,970	-1,151	-0.07%	-1,648	180	1,468	2	3,292
NAVER	402,000	-0.62	368.8	76.8	70,366	3,402	0.04%	-459	-36	420	-2,142	-707
호텔신라	87,400	0.00	27.7	67.0	49,103	-1,370	-0.01%	893	-763	-90	-499	409
엔씨소프트	932,000	-1.06	45.0	66.3	2,677	159	-0.08%	161	9	-173	-108	-65
삼성전자	81,700	-1.33	850.7	66.0	1,401,031	-57,287	-0.08%	10,605	-29,802	25,237	-4,142	36,867
SK 하이닉스	138,500	-3.15	350.4	64.7	366,060	-11,999	-0.07%	2,619	5,817	-8,425	8,423	-3,940
하나금융지주	42,150	1.20	45.9	57.5	163,522	-2,161	-0.02%	-7,648	-3,601	11,334	3,692	7,642
롯데케미칼	312,000	4.17	73.2	55.3	12,512	-668	-0.08%	1,604	-485	-1,108	46	-442
현대건설	42,200	-1.06	11.5	52.3	21,793	-4,696	-0.04%	1,494	539	-2,038	1,455	2,282
삼성전기	194,000	-0.26	31.8	51.0	27,121	-206	-0.05%	419	-634	261	861	-585

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터