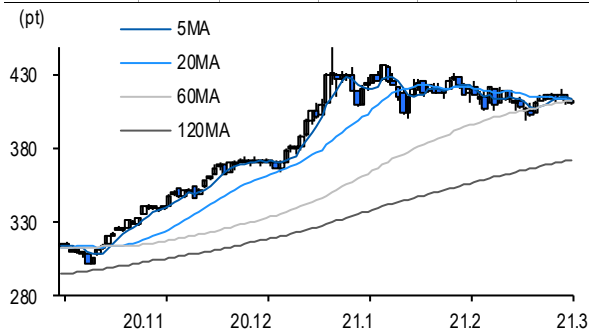


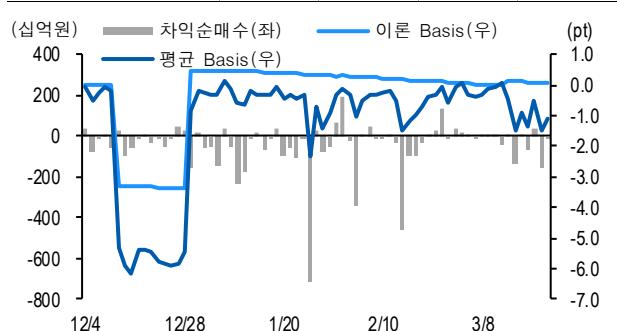
선물옵션시장 지표

2021.3.23

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.64	-0.07	-0.27	9,416.3	-
선물 6월물	412.40	0.40	1.65	19,986.3	226,495
선물 9월물	411.70	0.28	1.15	11.4	3,310
4월물(mini)	412.40	0.35	1.42	2,156.2	34,733
5월물(mini)	412.30	0.34	1.40	4.2	466



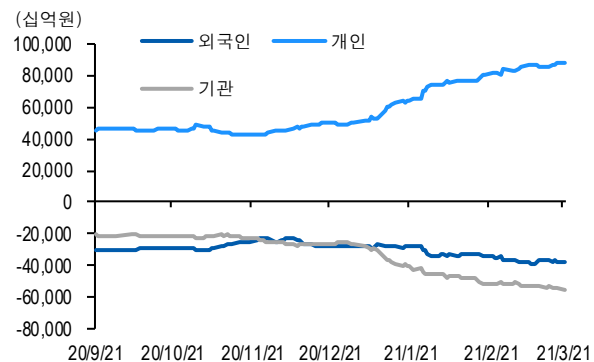
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.07	-1.11	-0.24	-0.29%
베이스(mini)	-0.47	-1.01	-0.24	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.55	-0.55	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.47	-0.20	-0.20	0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-546.3	18.1	-528.3	-8.9	-280.8	130.3	29.4	-0.7	-0.6	-6.3
개인	582.6	-6.8	575.7	0.0	0.9	-49.4	-4.3	-0.9	1.3	23.2
기관	-33.9	-11.1	-45.1	-0.7	-218.4	-88.2	-25.3	1.9	-0.5	-16.8
금융투자	262.8	6.6	269.4	-20.6	-26.3	-238.8	-25.5	1.9	-0.6	-12.1
투신	-63.9	-13.0	-76.8	0.0	-43.4	153.0	0.0	0.0	0.1	5.6
은행+보험+기타금융	-34.4	-14.8	-49.2	-1.0	-11.1	4.7	0.0	0.0	0.0	8.4
연기금+국가자재	-174.4	-1.1	-175.5	20.9	-121.0	-7.1	0.1	0.0	0.0	-18.7
기타법인	-2.3	-0.1	-2.4	0.0	5.3	7.3	0.2	-0.3	-0.2	-0.1

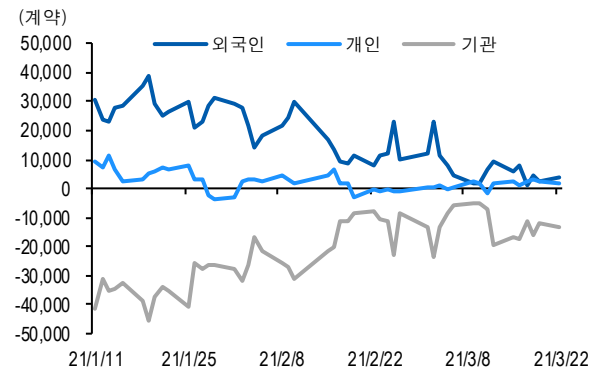
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



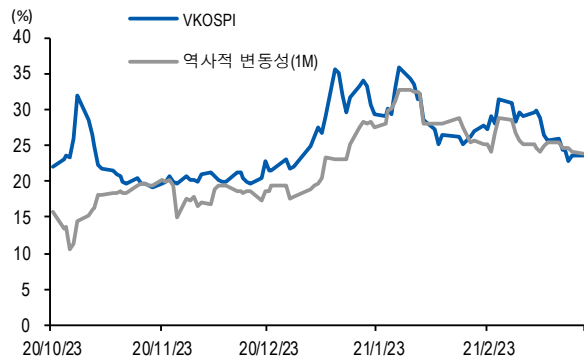
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	515,100	181.7	620,850	20.5%	지수옵션 전체	1,093,123	402.9	1,605,584
Put	578,023	221.1	984,734	21.5%	PCR(금액기준)	1.22	VKOSPI	23.70%(+0.09%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	4.23	-0.10	13,031	9,102	107	20.3	Put	415.0(K+1)	8.85	-1.45	1,020	4,021	-14	20.1
	417.5(K+2)	5.22	0.00	5,100	4,618	296	20.6		412.5(K+0)	7.64	-1.30	3,431	3,106	823	20.5
	415.0(K+1)	6.27	0.01	7,457	3,888	611	20.7		410.0(K-1)	6.55	-1.21	5,523	6,753	380	20.9
	412.5(K+0)	7.58	0.16	4,894	3,331	911	21.2		407.5(K-2)	5.62	-1.11	4,970	2,480	333	21.3
	410.0(K-1)	9.00	0.27	1,448	2,888	97	21.6		405.0(K-3)	4.86	-0.99	14,149	8,932	-18	21.9

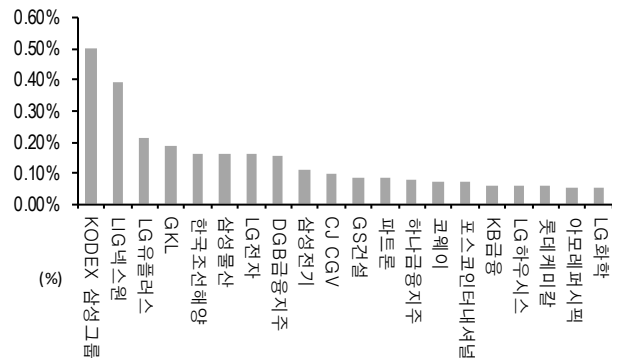
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,399,380	3,673.3	6,794,138	175,595	-13,291	45,363	-31,192	-6.3	23.2	-16.8			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한국금융지주	86,900	-0.69	15.9	97.0	26,201	-859	-0.02%	-1,320	433	887	833	54
NAVER	398,500	-0.87	345.5	96.2	70,302	-64	-0.01%	827	258	-1,090	-622	241
하나금융지주	41,850	-0.71	48.5	95.5	161,985	-1,537	0.08%	5,633	4,402	-10,300	-7,828	-6,588
카카오	495,000	0.51	144.8	93.7	30,981	11	-0.02%	-137	224	-47	-86	-853
롯데케미칼	317,500	1.76	64.9	87.9	13,435	923	0.06%	-821	1,422	-608	433	-1,736
삼성전자	81,600	-0.12	866.2	84.0	1,429,083	28,052	-0.04%	8,385	13,627	-23,669	13,716	-16,927
기아차	86,300	-1.15	191.8	77.4	193,354	-2,384	0.01%	-8,320	438	7,856	3,161	5,359
SK 하이닉스	138,000	-0.36	246.4	66.0	350,402	-15,658	-0.01%	-1,925	-359	2,336	15,690	-275
LG 디스플레이	21,900	2.82	38.7	64.3	601,773	37,031	-1.78%	-27,892	31	28,363	571	1,285
SK 텔레콤	255,500	0.20	21.1	62.7	22,267	-413	0.00%	-197	-368	565	293	272

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터