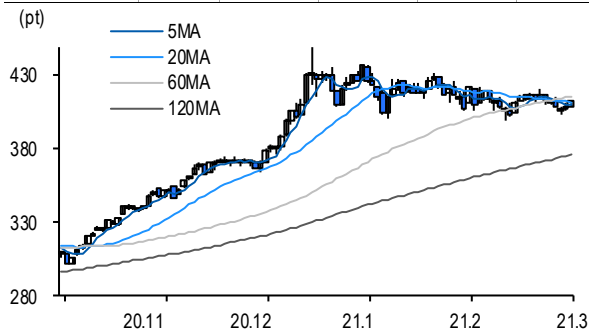


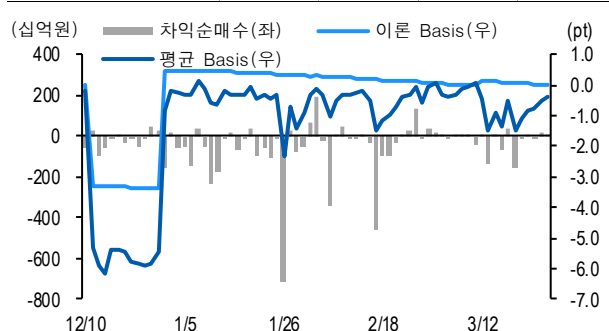
선물옵션시장 지표

2021.3.29

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.89	1.07	4.36	11,695.6	-
선물 6월물	411.95	0.94	3.85	19,605.2	232,473
선물 9월물	411.50	0.96	3.90	12.2	3,415
4월물(mini)	411.98	0.98	4.00	2,071.0	59,160
5월물(mini)	412.10	1.00	4.10	4.3	687



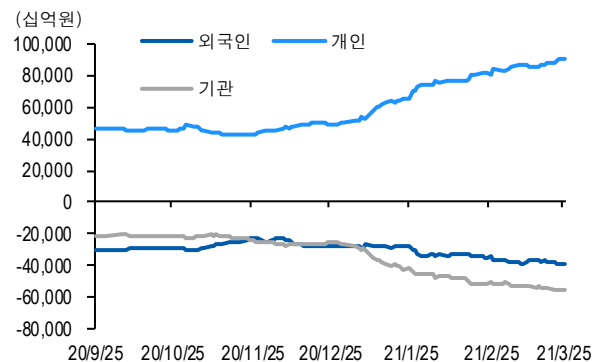
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.03	-0.36	-0.94	-0.10%
베이스(mini)	-0.50	-0.53	-0.91	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.56	-0.50	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.50	-1.04	-1.04	-0.13%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	295.9	0.4	296.3	20.6	120.8	182.9	78.5	1.8	2.7	51.7
개인	-419.6	-46.9	-466.5	0.0	0.3	186.7	-36.3	0.6	-0.6	37.2
기관	125.6	37.2	162.9	-10.2	-119.6	-426.2	-35.4	-2.4	-1.7	-89.1
금융투자	188.0	34.9	222.9	2.6	-3.2	-408.6	-35.5	-4.1	0.5	-49.2
투신	-57.3	3.3	-54.0	0.0	-39.7	234.9	0.3	-0.1	0.1	-5.6
은행+보험+기타금융	-2.4	3.6	1.3	0.0	-9.7	-43.0	-0.2	1.8	-2.3	-0.6
연기금+국가지자체	-52.5	-0.7	-53.3	-12.8	-73.6	-209.5	0.0	0.0	0.0	-33.7
기타법인	-2.0	9.3	7.4	0.0	0.0	56.6	-6.7	0.0	-0.4	0.2

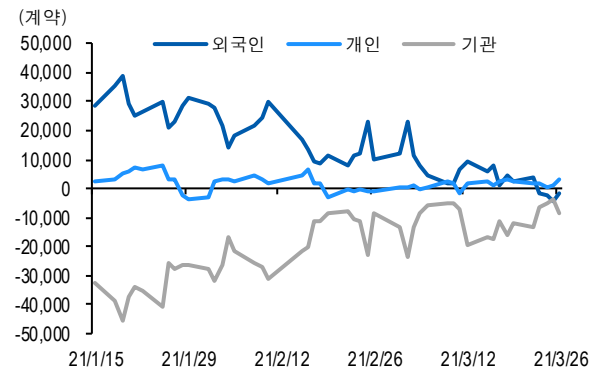
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	581,394	211.9	743,854	16.7%	지수옵션 전체	1,182,490	398.8	1,831,710
Put	601,096	186.9	1,087,856	19.8%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	20.36%(-1.33%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	415.0(K+3)	4.20	0.98	23,660	10,034	161	16.7	Put	410.0(K+1)	4.83	-2.43	9,340	10,389	2,810	18.5
	412.5(K+2)	5.36	1.24	10,712	6,054	375	16.8		407.5(K+0)	3.89	-2.15	9,189	4,869	1,218	18.8
	410.0(K+1)	6.71	1.55	9,658	6,127	1,579	16.9		405.0(K-1)	3.13	-1.85	17,018	10,878	-451	19.2
	407.5(K+0)	8.24	1.80	5,906	4,084	487	17.0		402.5(K-2)	2.53	-1.58	16,216	5,255	928	19.7
	405.0(K-1)	10.00	2.11	1,708	2,645	22	17.3		400.0(K-3)	2.03	-1.36	37,932	13,492	128	20.2

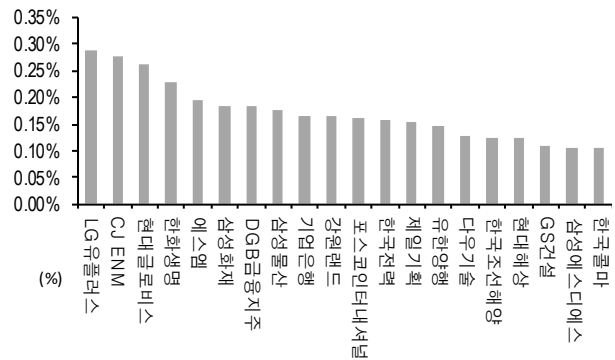
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,309,452	3,464.3	7,333,703	412,422	91,345	66,548	-157,525	51.7	37.2	-89.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	40,800	-0.12	38.1	71.5	164,766	135	0.07%	1,600	-619	-663	-3,127	2,476
카카오	495,500	2.06	129.4	70.3	33,047	1,986	0.01%	699	577	-1,331	-824	-547
삼성전기	187,000	0.00	42.4	65.3	27,425	-62	-0.06%	-1,273	3,440	-2,169	-173	792
삼성전자	81,300	0.62	672.7	64.8	1,405,588	12,768	-0.01%	16,903	5,857	-22,689	-769	-7,650
SK 하이닉스	135,000	1.12	326.8	63.9	301,146	3,503	-0.08%	-2,209	18,682	-16,658	-5,727	400
한국금융지주	86,700	0.58	8.1	61.1	23,394	731	0.03%	1,306	-77	-1,229	-595	-338
호텔신라	87,000	-0.46	22.3	60.1	44,049	-2,988	0.00%	-2,947	-51	3,008	2,030	1,596
NAVER	382,000	0.39	152.5	58.0	61,507	979	0.03%	990	2,296	-3,421	-734	-1,262
기아차	80,400	-1.23	129.7	57.5	121,919	-25,692	-0.12%	-1,287	-9,965	11,199	16,645	6,754
롯데케미칼	303,500	-1.46	36.2	57.0	11,369	-1,156	-0.01%	-941	6	931	298	1,468

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터