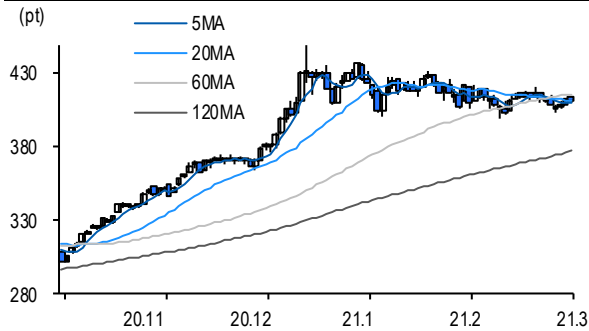


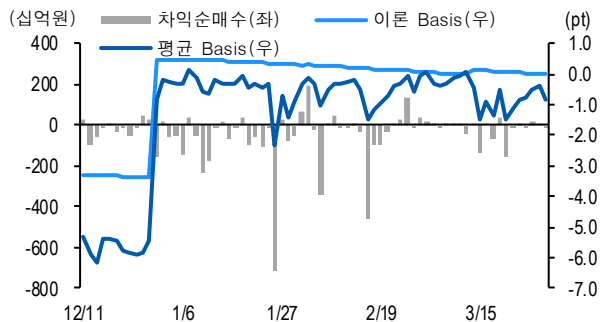
선물옵션시장 지표

2021.3.30

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.05	-0.20	-0.84	11,737.1	-
선물 6월물	411.80	-0.04	-0.15	21,120.4	228,130
선물 9월물	410.95	-0.13	-0.55	12.6	3,407
4월물(mini)	411.66	-0.08	-0.32	2,402.3	59,635
5월물(mini)	411.50	-0.15	-0.60	3.6	732

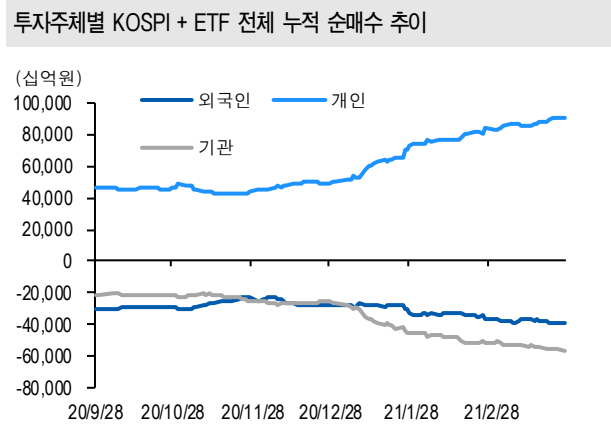


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.01	-0.82	-0.25	-0.20%	
베이스스(mini)	-0.52	-0.83	-0.39	-0.07%	
제1스프레드(SP)	0.11	-0.49	-0.50	-0.15%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.52	-0.40	-0.40	0.03%	

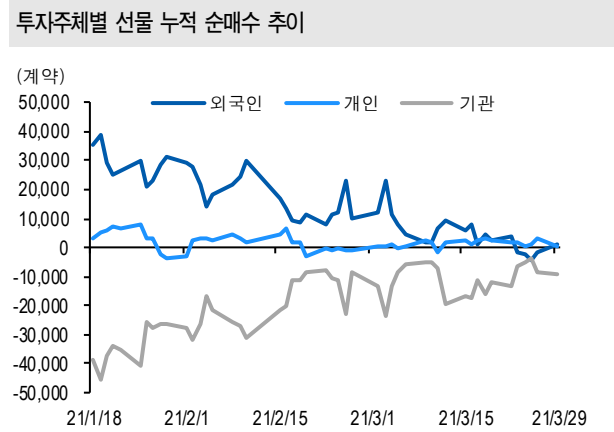


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	49.4	15.2	64.6	-2.2	-59.9	348.3	-49.9	1.1	3.4	-18.8
개인	659.6	-0.4	659.2	0.0	-3.4	-253.6	-5.7	0.0	-0.8	6.4
기관	-711.7	-13.9	-725.6	-6.5	-42.3	-165.6	57.5	-0.8	-2.8	13.8
금융투자	-446.0	13.1	-432.9	-6.5	-18.0	230.3	57.7	-0.6	-2.2	-43.9
투신	-15.1	-24.1	-39.2	0.0	6.3	-284.3	-0.2	-0.1	0.2	-4.4
은행+보험+기타금융	-47.6	0.3	-47.3	0.0	-1.2	4.2	0.0	0.0	-0.7	1.9
연기금+국가자재	-165.7	-0.5	-166.2	-0.1	-24.5	-115.9	0.0	0.0	0.0	60.2
기타법인	2.7	-0.8	1.8	0.0	-0.2	70.9	-1.8	-0.3	0.2	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

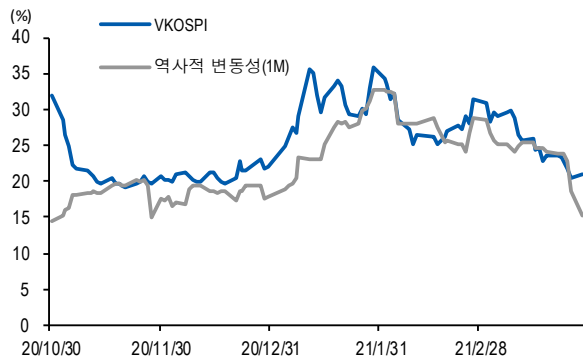
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	714,616	218.7	766,044	19.2%	지수옵션 전체	1,502,346	466.2	1,897,269
Put	787,730	247.5	1,131,225	20.2%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	21.01%(+0.65%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	2.29	-0.27	61,587	17,318	444	19.2	Put	415.0(K+1)	7.24	-0.08	4,268	4,478	82	18.6
	417.5(K+2)	3.04	-0.21	27,100	9,508	1,468	19.2		412.5(K+0)	5.90	-0.08	7,948	4,053	401	18.9
	415.0(K+1)	3.91	-0.29	26,280	12,084	2,050	19.1		410.0(K-1)	4.75	-0.08	12,721	10,719	330	19.3
	412.5(K+0)	5.05	-0.31	12,882	6,461	407	19.3		407.5(K-2)	3.83	-0.06	14,607	4,422	-447	19.8
	410.0(K-1)	6.48	-0.23	7,568	6,559	432	20.0		405.0(K-3)	3.10	-0.03	43,098	12,421	1,543	20.5

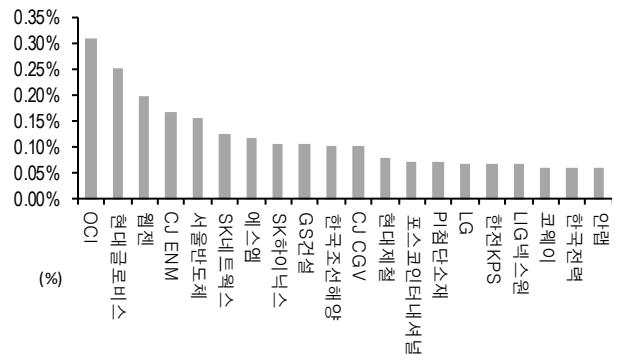
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,968,670	3,526.3	7,281,274	-52,429	-68,117	24,234	45,139	-18.8	6.4	13.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한국금융지주	86,200	-0.58	19.5	102.5	20,978	-2,416	-0.11%	-276	-364	640	2,155	112
하나금융지주	41,350	1.35	33.3	83.9	162,930	-1,836	0.02%	3,797	-1,687	-1,500	-2,049	1,868
삼성전기	184,500	-1.34	42.8	74.2	27,185	-240	-0.08%	528	1,457	-1,983	-970	395
SK 하이닉스	132,500	-1.85	339.1	71.4	312,504	11,358	0.11%	605	7,077	-7,672	-15,321	170
호텔신라	86,400	-0.69	21.0	71.1	43,864	-185	0.00%	-385	109	276	815	-539
삼성전자	81,500	0.25	745.0	61.5	1,375,755	-29,833	-0.08%	6,769	244	-6,923	-36,307	33,500
SK 텔레콤	270,000	-1.64	61.0	57.1	25,429	-1,330	0.05%	-1,424	274	1,150	-300	1,329
기아차	81,100	0.87	113.5	56.3	121,995	76	-0.10%	5,548	1,477	-7,029	430	-4,797
롯데케미칼	300,500	-0.99	32.1	55.1	9,005	-2,364	-0.21%	-533	59	474	2,114	959
POSCO	326,000	3.00	94.3	52.8	15,637	3,303	-0.07%	1,388	200	-1,589	-4,623	305

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터