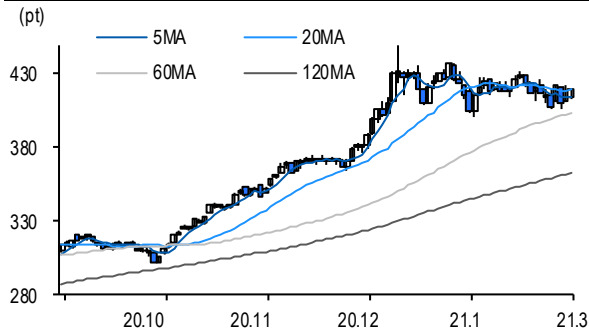
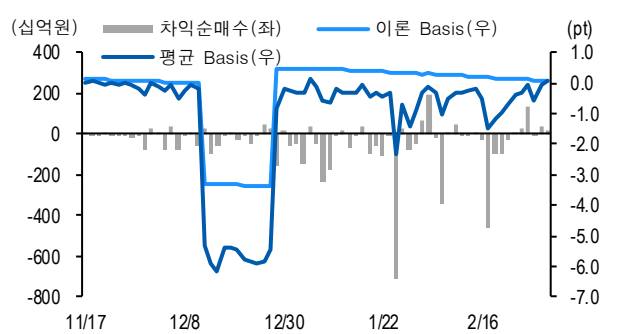


선물옵션시장 지표 2021.3.4

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	420.27	1.32	5.47	10,019.4	-
선물 3월물	419.40	1.06	4.40	24,417.4	234,141
선물 6월물	418.85	1.17	4.85	160.8	34,635
3월물(mini)	419.40	1.06	4.40	4,061.3	123,242
4월물(mini)	419.00	1.07	4.44	32.3	15,929

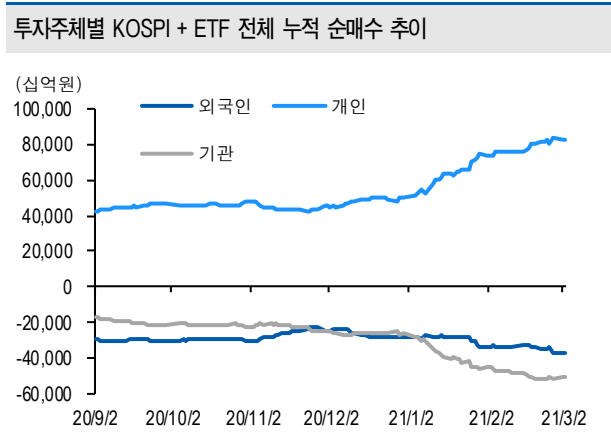


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.07	0.10	-0.87	0.01%	
베이스스(mini)	0.07	0.08	-0.87	0.00%	
제1스프레드(SP)	0.16	-0.70	-0.70	-0.20%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.07	-0.87	-0.87	-0.22%	

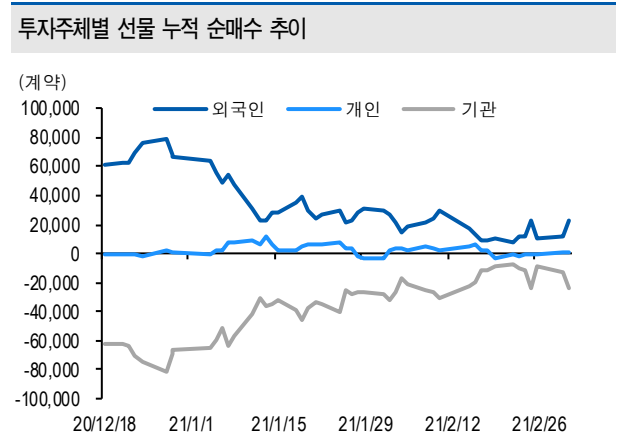


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-21.3	-28.2	-49.5	21.5	180.3	547.0	572.1	2.4	-2.2	49.3	
개인	-654.6	3.1	-651.5	0.0	2.2	2.1	-11.3	-2.0	0.0	6.1	
기관	690.4	28.8	719.2	-6.3	43.7	-516.3	-540.2	0.8	1.0	-54.1	
금융투자	650.7	-9.2	641.4	-1.6	27.9	-630.5	-541.2	1.5	1.8	-35.6	
투신	60.2	23.4	83.6	0.0	39.1	183.2	0.9	-0.7	0.0	5.3	
은행+보험+기타금융	7.6	32.7	40.2	0.0	-3.6	-33.3	0.1	0.1	-0.9	1.6	
연기금+국가자재	-47.2	-4.3	-51.5	-6.8	-40.8	-35.8	0.1	0.0	0.0	-25.4	
기타법인	-14.5	-3.7	-18.2	0.0	0.2	-32.8	-20.6	-1.2	1.2	-1.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





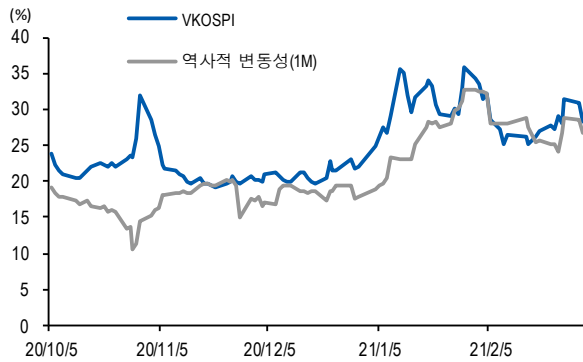
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	890,101	315.9	725,374	23.8%	지수옵션 전체	1,712,945	585.0	2,191,266		
Put	822,844	269.1	1,465,892	29.4%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	28.31%(-2.66%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	422.5(K+3)	5.23	0.74	11,313	4,079	-192	23.7	Put	417.5(K+1)	5.91	-3.20	1,483	3,399	-40	27.6
	420.0(K+2)	6.44	0.98	14,510	8,333	-563	23.8		415.0(K+0)	4.97	-2.92	4,966	4,392	354	28.0
	417.5(K+1)	7.82	1.20	7,917	3,941	257	24.0		412.5(K-1)	4.18	-2.62	6,606	2,962	100	28.6
	415.0(K+0)	9.37	1.48	6,616	3,851	-64	24.2		410.0(K-2)	3.51	-2.37	15,655	6,480	663	29.2
	412.5(K-1)	11.35	1.93	1,468	2,766	-101	25.7		407.5(K-3)	2.96	-2.11	13,867	8,985	1,500	29.9

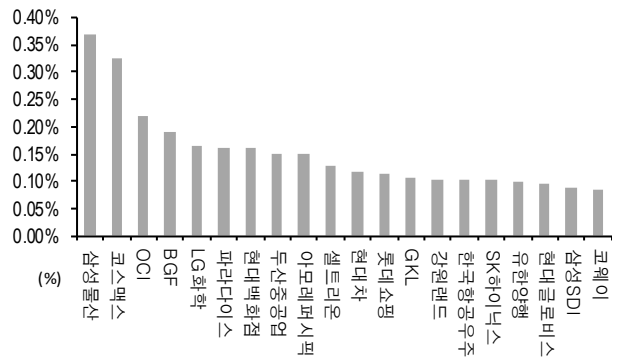
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,728,658	5,253.6	7,227,409	-62,235	107,547	-46,813	-58,394	49.3	6.1	-54.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	148,000	2.07	905.4	111.2	406,567	10,473	0.10%	151	-3,968	3,849	-3,003	-5,513
롯데케미칼	328,000	1.39	65.7	105.2	17,810	2,148	0.00%	-766	66	698	870	-1,704
엔씨소프트	963,000	1.80	60.4	98.3	3,362	63	0.04%	43	12	-64	70	-134
삼성전자	84,000	0.12	1,237.7	83.0	1,427,037	-164,988	0.04%	49,458	9,069	-58,618	-24,482	29,899
삼성전기	202,000	-0.25	80.8	82.9	39,248	-2,472	0.08%	-3,991	454	3,756	1,963	2,438
현대차	241,500	0.84	167.0	80.9	85,334	-2,434	0.12%	-334	133	211	-459	1,921
한화솔루션	46,150	2.21	40.9	80.2	67,181	290	-0.10%	-3,443	1,134	2,200	-1,314	-875
하나금융지주	38,800	2.51	39.8	77.1	161,118	2,965	0.08%	341	-3,053	3,113	-2,914	-2,303
NAVER	399,500	5.55	366.0	76.8	75,066	6,848	0.05%	2,157	-1,806	-402	-2,894	-2,828
삼성 SDI	697,000	1.75	153.9	76.7	22,951	320	0.09%	-785	497	304	35	93

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터