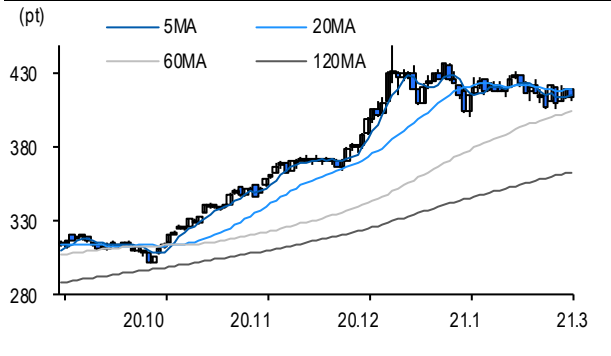
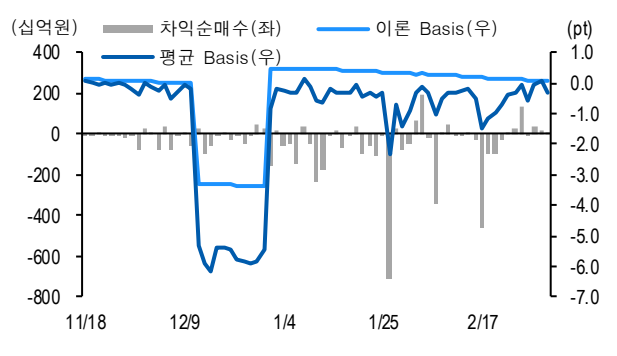


선물옵션시장 지표 2021.3.5

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	414.17	-1.45	-6.10	12,252.1	-
선물 3월물	413.35	-1.44	-6.05	33,507.6	228,973
선물 6월물	412.90	-1.42	-5.95	324.3	38,498
3월물(mini)	413.58	-1.39	-5.82	5,472.4	94,711
4월물(mini)	412.92	-1.45	-6.08	46.7	15,741

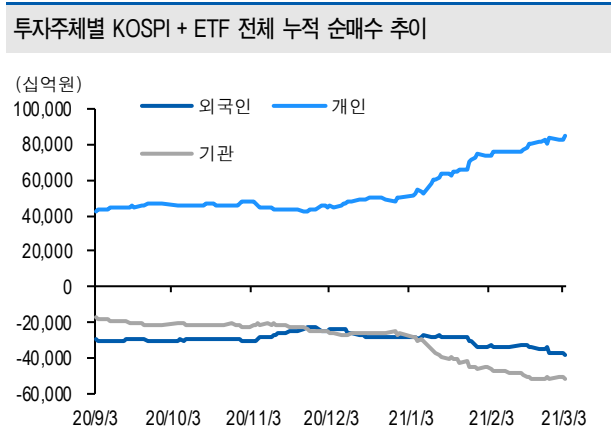


차익거래 관련 Market data		(pt)		
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.06	-0.28	-0.82	-0.08%
베이스스(mini)	0.06	-0.27	-0.59	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.69	-0.70	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	0.06	-0.82	-0.82	-0.21%

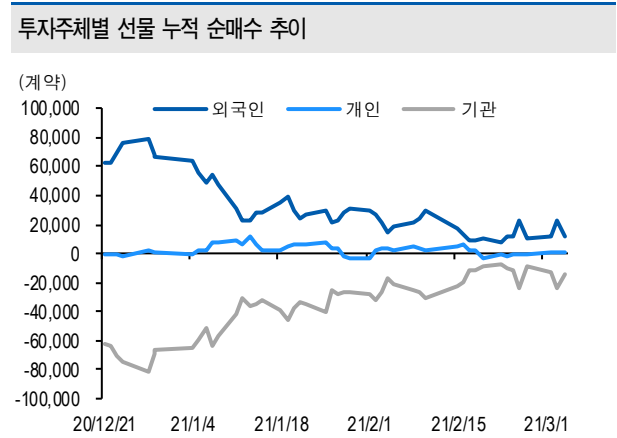


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-929.4	-27.0	-956.4	-3.0	-743.0	-260.0	-889.9	1.8	3.8	-41.6
개인	2,198.1	61.9	2,260.0	0.0	-0.2	77.3	0.5	-3.3	-0.9	-38.8
기관	-1,283.7	-35.7	-1,319.4	10.6	-126.1	142.6	869.0	2.1	-3.9	79.5
금융투자	-960.9	-75.0	-1,035.9	0.0	-30.4	453.7	869.0	2.4	-4.0	66.6
투신	17.1	-0.3	16.8	0.0	-1.3	-331.2	0.1	-0.2	-0.1	-52.7
은행+보험+기타금융	12.4	34.3	46.7	0.0	-0.8	42.5	0.0	0.0	0.2	2.6
연기금+국가자재	-322.0	-0.3	-322.4	10.6	-99.6	-22.4	-0.1	0.0	0.0	63.0
기타법인	14.9	0.8	15.7	0.0	0.2	40.0	20.4	-0.6	1.0	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,062,415	343.3	738,885	24.6%	지수옵션 전체	2,188,085	726.5	2,237,234
Put	1,125,670	383.2	1,498,349	28.8%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	29.50%(+1.19%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	1.63	-1.71	92,511	7,403	969	24.5	Put	422.5(K+1)	11.45	3.35	319	2,004	-33	26.3
	425.0(K+2)	2.14	-2.07	80,631	8,872	-3,297	24.5		420.0(K+0)	10.25	3.21	1,546	8,557	-372	28.4
	422.5(K+1)	2.80	-2.43	43,922	4,996	917	24.5		417.5(K-1)	8.72	2.81	1,650	3,121	-278	28.4
	420.0(K+0)	3.60	-2.84	28,813	8,395	62	24.6		415.0(K-2)	7.35	2.38	6,160	5,037	645	28.4
	417.5(K-1)	4.57	-3.25	11,487	4,221	280	24.7		412.5(K-3)	6.24	2.06	4,899	3,071	109	29.0

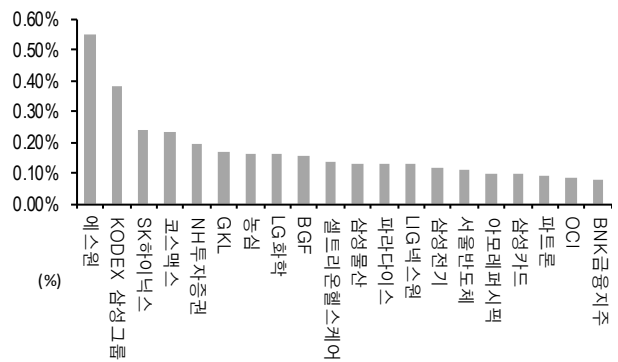
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,393,678	5,545.7	7,105,911	-121,498	-60,910	-82,110	146,240	-41.6	-38.8	79.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	321,000	-2.13	98.8	115.0	19,044	1,234	0.06%	267	351	-723	455	-1,146
엔씨소프트	958,000	-0.52	87.9	94.6	3,300	-62	0.03%	-110	97	11	-175	195
이마트	182,500	-1.35	53.6	90.3	7,460	-2,072	-0.12%	-930	-135	978	460	857
SK 이노베이션	263,500	-1.13	107.6	72.7	41,648	1,594	0.01%	-1,213	707	502	1,081	-1,480
하나금융지주	38,700	-0.26	67.0	71.6	151,593	-9,525	0.03%	-260	2,895	-3,099	752	3,695
LG 화학	868,000	-0.91	211.1	71.4	16,666	-22	0.16%	34	-823	774	-170	59
삼성 SDI	678,000	-2.73	178.7	71.0	22,068	-883	0.03%	-484	-1,080	1,663	1,077	584
삼성전기	194,500	-3.71	88.7	71.0	38,810	-438	0.11%	196	670	-1,071	-420	74
호텔신라	84,700	0.36	35.5	70.3	31,632	2,126	0.07%	2,264	722	-2,845	-1,683	-2,541
NAVER	391,500	-2.00	395.4	69.8	74,887	-179	0.07%	-1,961	-944	2,855	-3,319	3,154

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터