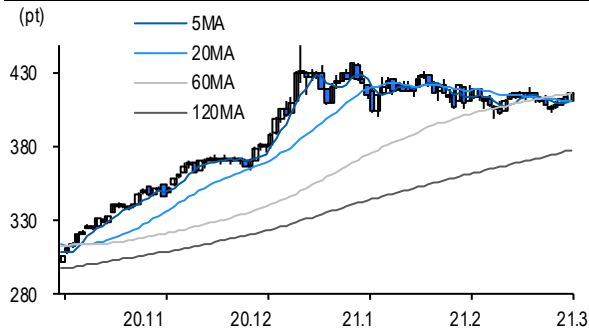
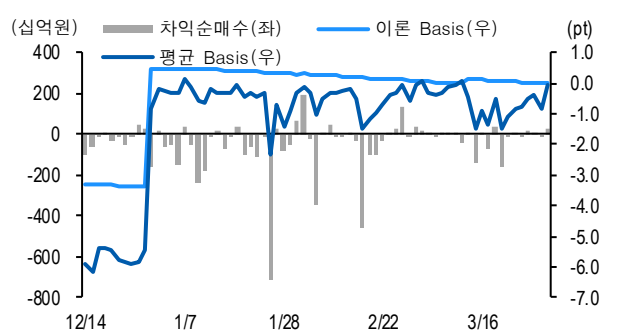


선물옵션시장 지표 2021.3.31

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	416.61	1.11	4.56	9,697.6	-
선물 6월물	415.55	0.91	3.75	19,565.8	227,476
선물 9월물	415.00	0.99	4.05	11.0	3,397
4월물(mini)	415.42	0.91	3.76	2,057.5	62,747
5월물(mini)	415.60	1.00	4.10	6.7	760

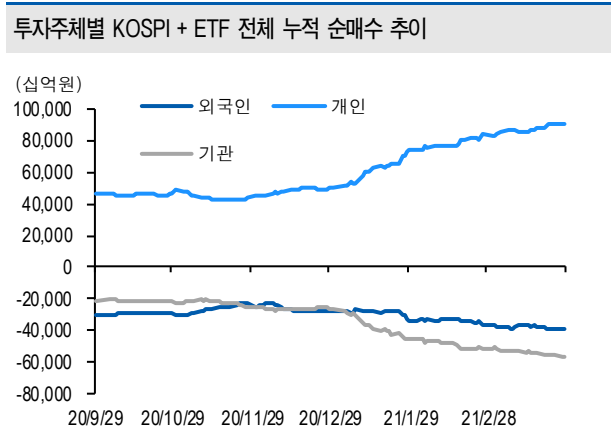


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.01	-0.03	-1.06	-0.01%
베이스(mini)	-0.53	-0.14	-1.19	0.09%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.53	-0.45	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.53	-1.14	-1.14	-0.15%

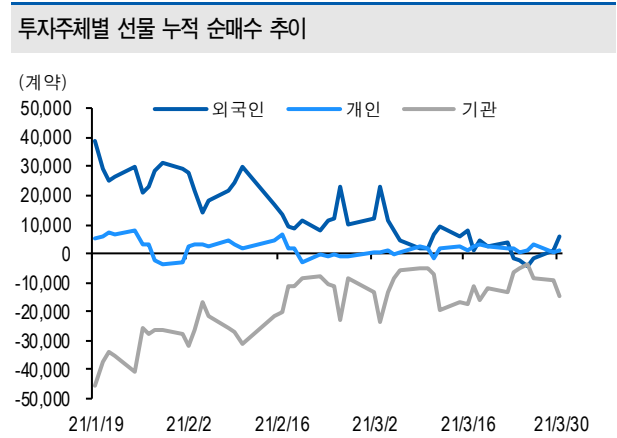


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	339.8	-28.8	311.1	15.6	292.4	582.1	-70.8	4.6	1.8	40.5
개인	-603.9	63.8	-540.1	0.0	-3.3	94.7	-22.2	1.1	1.5	69.3
기관	253.9	-34.6	219.3	8.7	-15.4	-699.1	100.3	-5.7	-3.4	-116.2
금융투자	295.8	-9.7	286.1	-1.7	42.3	-765.1	98.0	-5.2	-3.2	-124.9
투신	-25.0	-15.5	-40.6	0.0	-31.3	91.2	2.3	-0.4	-0.3	66.5
은행+보험+기타금융	12.1	-8.5	3.7	0.0	0.8	-6.1	0.0	0.0	0.0	0.6
연기금+국가자재	-26.1	-0.1	-26.2	10.4	-11.7	-19.2	0.0	0.0	0.0	-58.4
기타법인	10.2	-0.4	9.7	0.0	-0.2	22.4	-7.3	-0.1	0.2	6.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	833,314	293.5	776,356	16.8%	지수옵션 전체	1,463,168	473.2	1,933,463
Put	629,854	179.6	1,157,107	22.1%	PCR(금액기준)	0.61	VKOSPI	20.64%(-0.37%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	3.20	0.91	63,889	17,233	-85	16.9	Put	415.0(K+1)	4.97	-2.27	8,254	6,070	1,592	21.0
	417.5(K+2)	4.20	1.16	22,946	8,275	-1,233	16.7		412.5(K+0)	3.95	-1.95	9,198	4,923	870	21.2
	415.0(K+1)	5.45	1.54	15,389	12,440	356	16.6		410.0(K-1)	3.11	-1.64	25,580	11,493	774	21.5
	412.5(K+0)	6.92	1.87	7,384	6,357	-104	16.5		407.5(K-2)	2.48	-1.35	34,213	7,284	2,862	22.0
	410.0(K-1)	8.60	2.12	5,577	5,995	-564	16.4		405.0(K-3)	1.96	-1.14	39,393	14,001	1,580	22.5

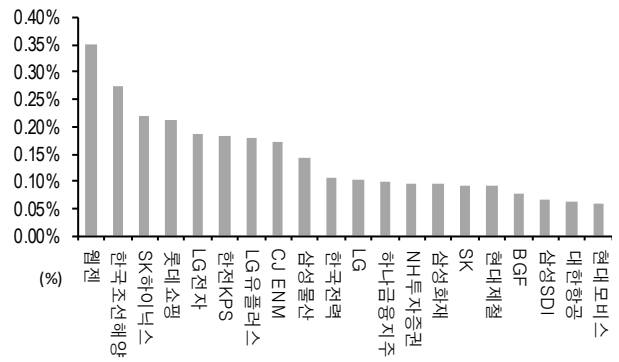
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,090,706	3,514.8	7,436,732	155,458	15,157	61,764	-83,298	40.5	69.3	-116.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	41,350	0.00	61.3	84.2	167,499	4,569	0.10%	-8,062	1,404	6,567	-1,175	-3,688
호텔신라	86,600	0.23	18.2	77.2	43,312	-552	-0.02%	-1,654	829	825	1,799	-204
SK 하이닉스	135,000	1.89	339.4	76.7	335,557	23,053	0.22%	2,302	15,890	-18,438	-27,204	-3,825
LG 유플러스	12,350	0.41	15.3	71.5	375,861	-49,729	0.18%	2,958	-9,525	6,567	1,183	5,384
삼성전자	82,200	0.86	706.6	66.0	1,400,326	24,571	0.03%	3,290	16,363	-25,291	-20,787	-20,550
한국금융지주	86,100	-0.12	13.4	65.5	19,528	-1,450	-0.04%	-472	287	185	1,286	-366
SK 텔레콤	268,000	-0.74	47.9	65.0	24,341	-1,088	0.01%	-934	125	809	309	689
삼성 SDI	669,000	2.61	140.7	63.8	25,581	4,068	0.07%	2,923	-142	-2,850	-1,429	-2,372
카카오	492,000	1.03	91.2	59.8	31,263	-200	-0.01%	1,058	-100	-1,017	-572	-453
NAVER	376,000	1.08	139.8	59.6	59,223	230	0.01%	942	566	-1,721	-320	-1,418

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터