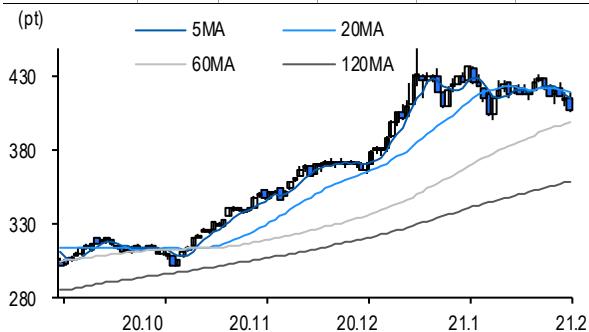


선물옵션시장 지표

2021.2.25

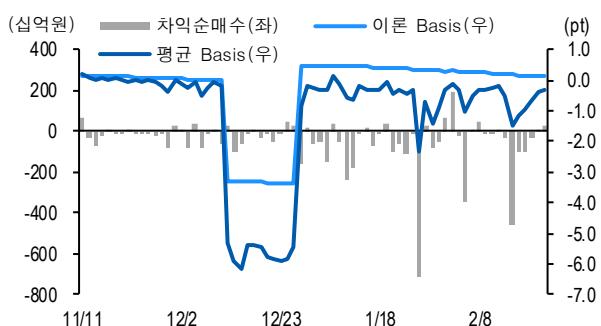
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	407.16	-2.08	-8.66	14,294.5	-
선물 3월물	407.35	-2.15	-8.95	38,462.1	237,169
선물 6월물	406.80	-2.07	-8.60	339.3	31,575
3월물(mini)	407.62	-2.09	-8.58	6,088.8	82,012
4월물(mini)	407.10	-1.99	-8.26	89.1	11,833



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.12	-0.28	0.19	-0.10%
베이시스(mini)	0.12	-0.29	0.46	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.78	-0.75	-0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	0.73	0.73	0.15%

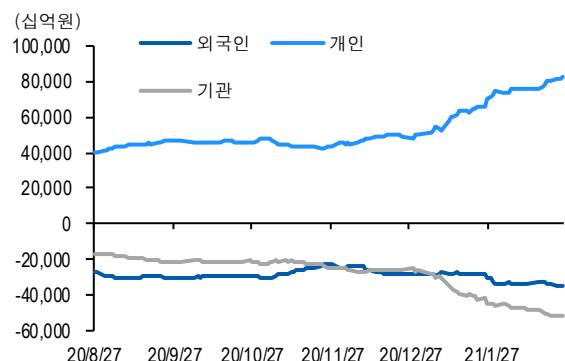


투자주체별 매매 동향 (십억원)

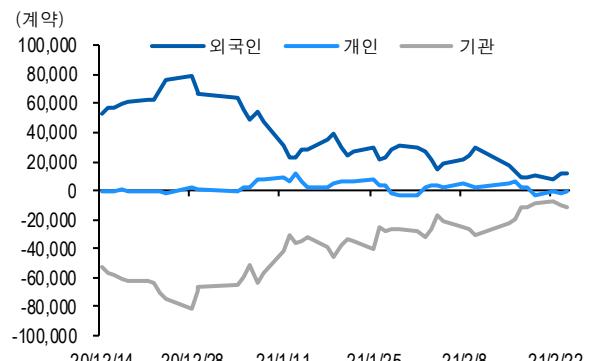
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-426.8	-12.3	-439.1	18.5	-354.9	-110.9	176.0	-4.1	2.7	6.5
개인	561.2	65.7	626.9	0.0	-2.0	56.9	16.4	-0.7	1.9	-60.3
기관	-135.1	-63.2	-198.4	10.6	-63.4	98.4	-192.6	5.6	-4.0	52.6
금융투자	252.9	-133.3	119.6	-2.4	3.9	446.5	-191.3	6.1	-3.9	34.7
투신	-69.3	-19.3	-88.5	0.0	-11.9	-371.9	-1.1	-0.5	-0.1	-46.0
은행+보험+기타금융	-40.1	86.9	46.9	0.0	-24.1	37.2	-0.1	0.0	0.0	4.1
연기금+국가지자체	-205.0	4.5	-200.5	12.9	-27.9	-13.5	0.0	0.0	0.0	59.8
기타법인	0.8	9.8	10.6	0.0	-0.7	-44.3	0.2	-0.8	-0.5	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

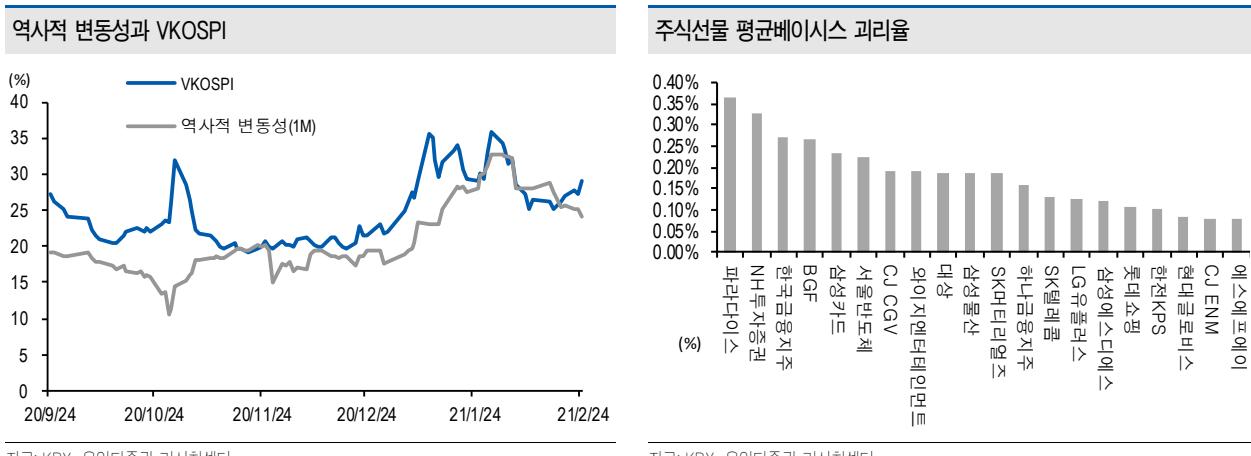


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,067,728	368.4	701,603	23.9%	지수옵션 전체		2,228,126	826.8	2,034,263		
Put	1,160,398	458.4	1,332,660	24.9%	PCR(금액기준)		1.24	VKOSPI	28.93% (+1.77%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	422.5(K+3)	2.74	-2.61	21,511	4,299	1,255	23.7	417.5(K+1)	13.90	5.02	1,265
	420.0(K+2)	3.42	-3.01	22,400	8,663	932	23.9	415.0(K+0)	12.15	4.42	3,481
	417.5(K+1)	4.12	-3.52	7,383	3,877	1,146	23.9	412.5(K-1)	10.90	4.15	2,712
	415.0(K+0)	5.04	-3.95	3,844	3,177	874	24.3	410.0(K-2)	9.88	3.99	5,911
	412.5(K-1)	6.09	-4.36	1,224	2,229	334	24.7	407.5(K-3)	8.67	3.55	6,154
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	417.5(K+1)	13.90	5.02	1,265	2,111	-80	22.5	415.0(K+0)	12.15	4.42	3,366
	412.5(K-1)	10.90	4.15	2,712	2,180	129	23.5	410.0(K-2)	9.88	3.99	5,704
	410.0(K-2)	9.88	3.99	5,911	5,704	-249	24.8	407.5(K-3)	8.67	3.55	6,710
	407.5(K-3)	8.67	3.55	6,154	6,710	638	25.2				

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

자료: KRX, 유인타증권 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	6,857,095	7,258.8	7,368,046	-99,857	5,162	-91,446	83,684	6.5	-60.3	52.6	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
엔씨소프트	934,000	0.54	111.7	100.1	3,089	456	0.01%	335	193	-560	-143
NAVER	375,500	-3.96	376.7	96.2	76,578	-4,115	0.03%	1,246	-139	-924	-366
현대건설	40,350	-4.16	26.0	94.1	16,442	-597	-0.08%	-4,636	104	4,532	2,527
SK 이노베이션	266,500	-6.65	293.8	92.1	57,768	-20,457	0.07%	3,639	-829	-2,881	3,392
삼성전자	81,900	-0.61	1,873.5	91.0	1,353,434	53,691	0.03%	11,440	-10,329	-1,211	-62,820
KB 금융	43,150	-1.26	80.2	90.8	83,749	3,831	0.03%	-1,423	-175	904	-1,849
SK 하이닉스	136,000	-2.16	1,085.8	87.9	470,323	-23,746	0.02%	1,083	-792	-514	19,593
이마트	172,500	-3.09	48.7	87.7	5,615	-5,743	-0.37%	58	-1,599	1,544	5,906
하나금융지주	36,950	0.82	62.6	87.6	172,095	11,474	0.16%	13,282	-1,291	-11,971	-11,962
삼성전기	187,000	-3.61	91.8	81.9	33,522	-880	-0.06%	-647	-691	1,339	1,140

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터