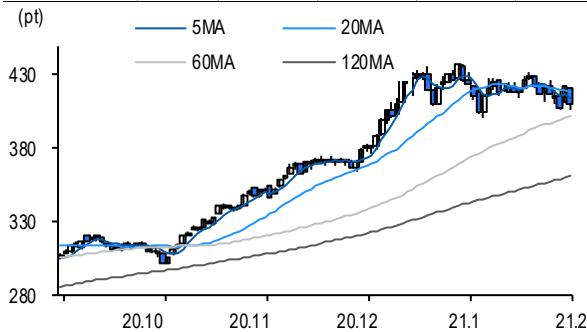


선물옵션시장 지표

2021.3.2

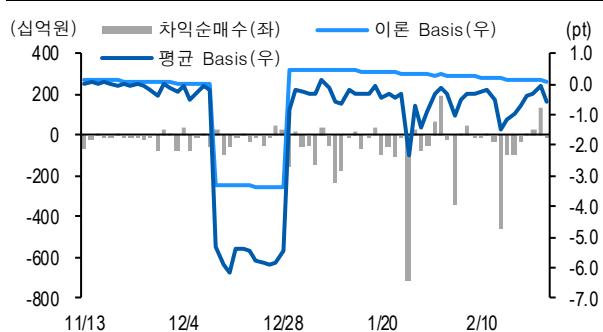
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	409.91	-2.98	-12.61	17,183.9	-
선물 3월물	409.95	-3.07	-13.00	36,697.8	236,915
선물 6월물	409.45	-2.96	-12.50	223.5	31,905
3월물(mini)	409.82	-3.11	-12.50	5,972.9	86,367
4월물(mini)	409.50	-2.89	-12.18	127.1	14,030



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.11	-0.60	0.04	-0.17%
베이시스(mini)	0.11	-0.59	-0.09	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.14	-0.72	-0.70	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	0.11	0.05	0.05	-0.01%



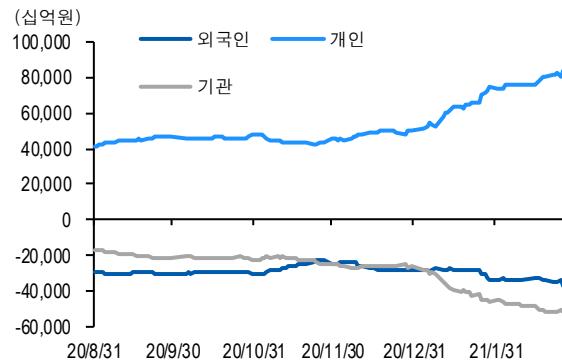
투자주체별 매매 동향

(십억원)

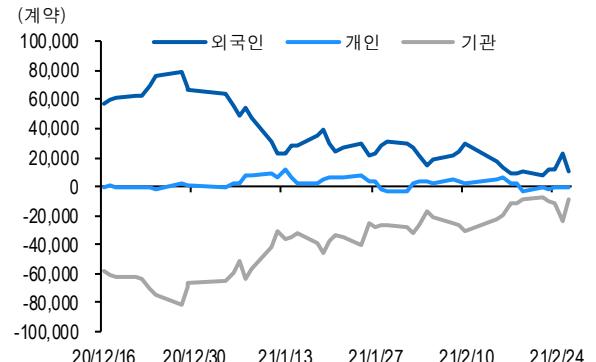
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-2,819.2	13.9	-2,805.2	-1.3	-2,348.4	-612.0	-760.9	-7.0	22.6	9.0
개인	3,782.4	-75.0	3,707.5	0.0	-1.4	-71.0	54.0	3.3	-2.3	-94.0
기관	-1,030.4	59.1	-971.3	-8.3	62.6	763.2	703.6	4.2	-17.4	90.3
금융투자	-891.8	-112.8	-1,004.6	4.1	18.8	1,217.9	700.6	2.5	-14.8	148.8
투신	-38.6	47.9	9.3	0.0	-13.6	-422.3	3.2	-0.6	-0.1	-134.3
은행+보험+기타금융	36.2	114.1	150.4	0.0	39.8	-45.6	-0.1	2.3	-2.5	3.3
연기금+국가지자체	-114.5	12.3	-102.3	-12.5	27.7	13.2	-0.1	0.0	0.0	72.5
기타법인	67.1	1.9	69.1	0.0	-0.5	-80.3	3.3	-0.5	-2.9	-5.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

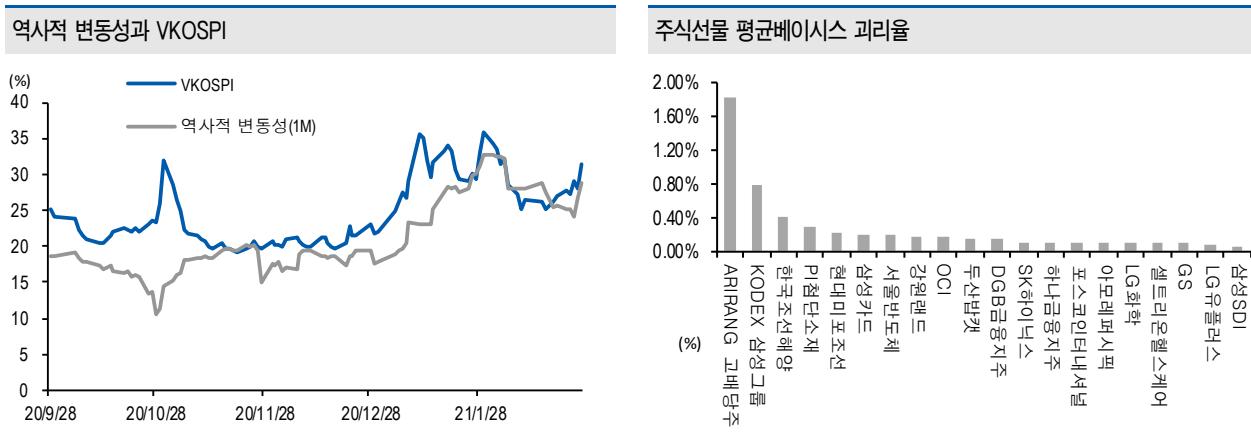


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		미결제약정	내재변동성
Call	817,611	286.1	699,954	26.4%	지수옵션 전체	2,060,360	840.0	2,118,370			
Put	1,242,749	553.9	1,418,416	27.2%	PCR(금액기준)	1.94	VKOSPI	31.34% (+3.42%p)			
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	430.0(K+3)	2.09	-3.04	64,811	11,311	-140	26.3	425.0(K+1)	17.85	8.42	195
	427.5(K+2)	2.55	-3.51	26,625	6,277	-401	26.3	422.5(K+0)	16.35	8.15	128
	425.0(K+1)	3.18	-4.11	43,631	13,294	2,191	26.7	420.0(K-1)	14.65	7.58	796
	422.5(K+0)	3.81	-4.69	23,473	4,724	296	26.6	417.5(K-2)	12.95	6.84	656
Put	420.0(K-1)	4.55	-5.34	14,843	9,037	552	26.6	415.0(K-3)	11.50	6.24	2,058
											3,477
											-86
											27.3

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	7,036,265	7,239.6	7,223,647	-344,794	38,024	-185,960	149,407	9.0	-94.0	90.3		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	318,000	-2.45	175.5	91.2	15,703	-4,816	-0.02%	330	-2,296	1,999	-1,499	5,327
삼성전기	190,000	-3.06	92.0	77.5	33,498	-301	0.00%	542	1,003	-1,537	1,502	-2,577
현대차	237,500	-3.65	491.6	76.3	87,486	-8,863	0.05%	6,215	125	-6,339	802	2,800
하나금융지주	37,150	-2.11	68.2	70.9	182,853	2,034	0.11%	-4,235	-437	4,572	-2,622	755
SK 하이닉스	142,500	-4.36	1,029.9	67.6	392,072	-69,912	0.11%	-2,184	-14,008	16,036	50,351	4,202
KB 금융	43,800	-2.12	75.1	67.5	83,069	149	0.02%	-2,534	-88	1,812	-144	4,208
기아차	80,200	3.89	679.4	64.9	99,740	1,556	-0.02%	-5,903	-7,895	13,695	2,635	2,926
LG 디스플레이	22,600	-3.83	72.9	61.8	557,844	-30,050	-0.98%	40,416	-13,064	-27,367	3,117	2,051
한국금융지주	87,300	-5.31	50.9	61.1	37,145	-23,640	-0.06%	1,387	1,771	-3,158	7,737	9,805
엔씨소프트	936,000	-3.80	74.4	61.0	3,031	227	-0.03%	-89	348	-203	-42	-120

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터