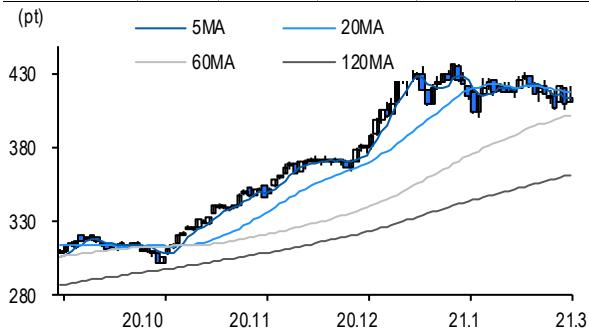


선물옵션시장 지표

2021.3.3

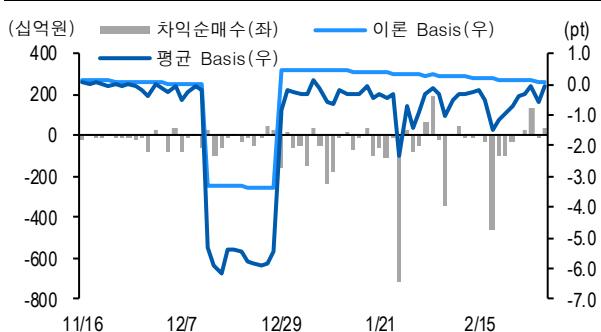
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	414.80	1.19	4.89	14,524.6	-
선물 3월물	415.00	1.23	5.05	31,874.9	233,533
선물 6월물	414.00	1.11	4.55	203.3	32,783
3월물(mini)	415.00	1.23	5.18	4,932.6	96,916
4월물(mini)	414.56	1.24	5.06	69.8	14,036



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.08	-0.06	0.20	-0.03%
베이시스(mini)	0.08	-0.06	0.20	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.72	-0.75	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	0.08	0.17	0.17	0.02%



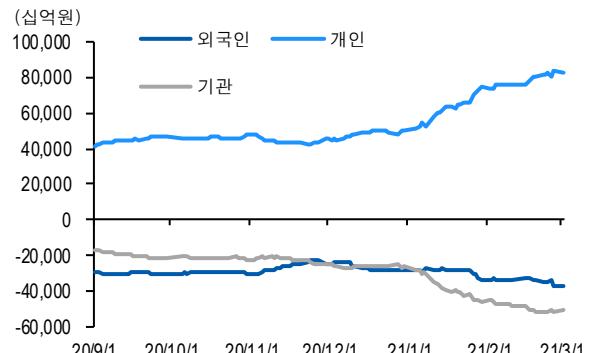
투자주체별 매매 동향

(십억원)

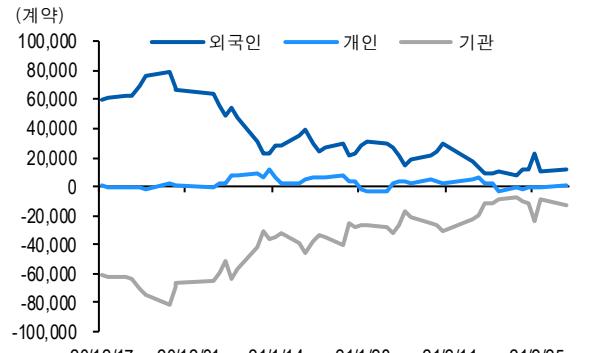
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	202.1	-18.0	184.1	19.0	73.3	-192.9	413.7	0.4	-3.6	-1.3
개인	-623.1	-75.6	-698.7	0.0	0.7	159.1	-8.1	-0.8	1.8	14.6
기관	441.6	92.7	534.4	16.8	-236.4	-55.2	-413.4	-1.0	0.1	-13.0
금융투자	558.5	92.8	651.3	0.0	-0.2	-136.4	-411.3	-0.5	0.3	-52.3
투신	9.5	24.3	33.8	0.0	-2.9	109.8	-2.1	-0.5	-0.1	108.5
은행+보험+기타금융	-43.2	-15.6	-58.8	1.7	-51.0	-12.5	0.0	0.0	-0.1	3.2
연기금+국가지자체	-108.4	0.2	-108.2	15.1	-191.2	-16.1	0.0	0.0	0.0	-72.4
기타법인	-20.6	0.9	-19.7	0.0	0.2	89.1	7.8	1.4	1.6	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

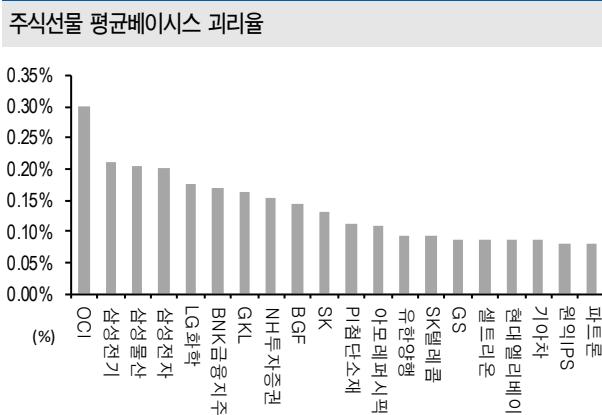
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	905,494	353.2	714,207	28.6%	지수옵션 전체		2,274,628	845.4	2,151,619						
Put	1,369,134	492.2	1,437,412	31.0%	PCR(금액기준)		1.39	VKOSPI	30.97%(-0.37%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량			
Call	417.5(K+3)	6.62	1.15	4,301	3,684	-90	28.6	Put	412.5(K+1)	6.80	-3.35	9,411	2,862	305	29.1
	415.0(K+2)	7.89	1.41	3,253	3,915	530	29.0		410.0(K+0)	5.88	-3.10	21,141	5,817	352	29.7
	412.5(K+1)	9.42	1.77	1,458	2,867	291	29.9		407.5(K-1)	5.07	-2.82	18,256	7,485	326	30.4
	410.0(K+0)	10.85	1.91	1,320	5,012	-15	30.0		405.0(K-2)	4.35	-2.56	36,355	6,296	-20	31.0
	407.5(K-1)	12.60	2.30	1,045	10,391	172	30.9		402.5(K-3)	3.71	-2.35	68,705	9,354	-1,295	31.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KBX 유통기획 리서치센터



자료: KBX 유파티^{증권} 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	6,086,396	7,077.4	7,289,644	65,997	-3,765	-39,124	48,766	-1.3	14.6	-13.0		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	946,000	1.07	115.2	106.3	3,299	268	0.02%	61	7	-65	-125	-18
삼성전기	202,500	6.58	174.5	79.0	41,720	8,222	0.21%	3,392	4,066	-7,457	-3,795	-8,751
SK 하이닉스	145,000	1.75	1,030.6	75.7	396,094	4,022	0.03%	-1,626	15,836	-14,078	-9,233	-90
LG 화학	894,000	7.07	456.1	74.2	17,334	-264	0.18%	185	-2,111	1,801	425	-1,412
이마트	170,500	0.59	25.7	73.1	5,004	-344	-0.25%	-455	-79	594	564	307
삼성 SDI	685,000	0.59	285.9	72.5	22,631	-275	0.08%	440	-357	-34	-543	-67
삼성전자	83,900	1.33	1,989.2	71.7	1,592,025	125,263	0.20%	23,175	7,608	-30,685	-81,224	-39,810
기아차	80,500	0.37	288.1	71.5	105,230	5,490	0.09%	4,056	4,433	-8,491	-1,942	-9,712
카카오	491,500	0.00	324.9	71.2	31,039	120	0.04%	-695	2,609	-2,054	-2,220	-477
NAVER	378,500	0.26	304.8	70.2	68,218	769	0.02%	-827	392	422	-360	406

자료: KBX 유통기획 리서치센터