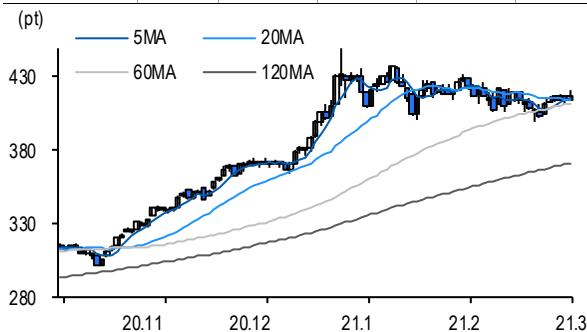


선물옵션시장 지표

2021.3.19

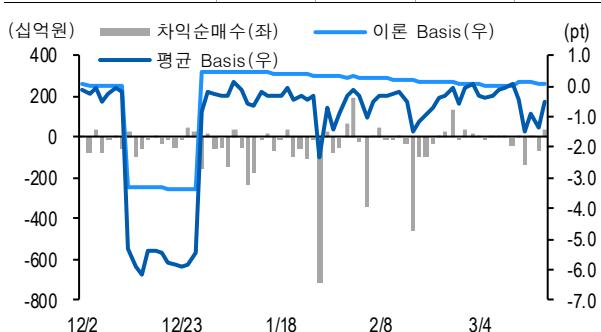
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	417.06	0.74	3.05	10,506.2	-
선물 6월물	416.95	1.01	4.15	23,222.4	223,381
선물 9월물	416.40	0.99	4.10	13.9	3,079
4월물(mini)	416.98	0.98	4.04	2,369.0	30,459
5월물(mini)	416.70	0.93	3.84	3.1	349



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.11	-0.53	-0.11	-0.15%
베이시스(mini)	-0.43	-0.53	-0.08	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.62	-0.50	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.43	-0.07	-0.07	0.09%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

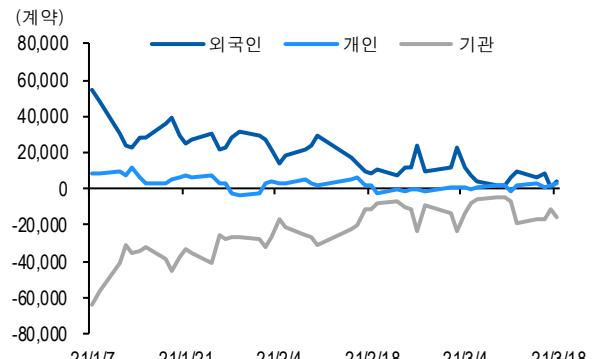
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	480.9	19.9	500.8	33.4	294.1	361.7	-20.4	2.4	9.5	-14.6
개인	-616.5	13.5	-603.0	0.0	-1.5	84.6	22.5	-2.5	-2.5	134.8
기관	134.9	-33.0	101.9	-0.2	-256.3	-486.5	3.0	1.2	-7.2	-123.9
금융투자	334.3	7.0	341.3	-0.2	-7.5	-732.2	2.5	1.2	-7.5	-87.4
투신	-4.0	-22.9	-27.0	-2.1	-13.5	239.6	0.4	-0.1	0.3	20.6
은행+보험+기타금융	-25.7	-17.8	-43.5	0.0	-19.8	7.9	0.0	0.1	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-189.3	-0.2	-189.5	2.1	-216.7	-1.8	0.0	0.0	0.0	-57.1
기타법인	0.7	-0.5	0.2	0.0	-0.1	40.1	-5.2	-1.1	0.2	3.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

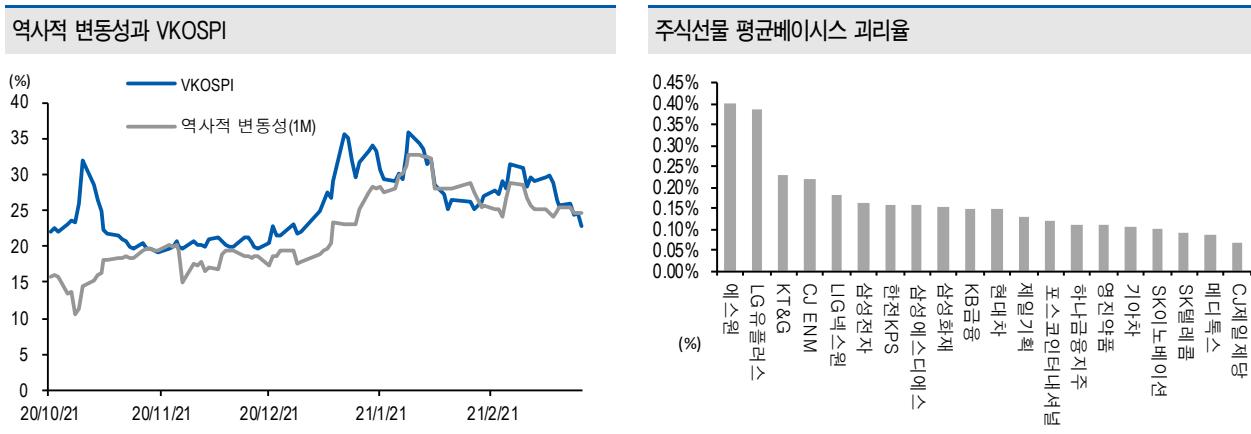


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	477,882	224.9	570,892	20.0%	지수옵션 전체		1,085,108	449.4	1,479,204		
Put	607,226	224.5	908,312	20.6%	PCR(금액기준)		1.00	VKOSPI	22.69%(-1.84%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	422.5(K+3)	5.60	0.65	7,046	3,026	655	20.0	417.5(K+1)	8.38	-2.97	3,541
	420.0(K+2)	6.64	0.81	8,341	7,866	655	20.0	415.0(K+0)	7.24	-2.86	6,528
	417.5(K+1)	7.88	1.03	5,501	3,769	706	20.3	412.5(K-1)	6.22	-2.61	5,316
	415.0(K+0)	9.23	1.24	3,428	3,327	78	20.6	410.0(K-2)	5.37	-2.38	10,202
	412.5(K-1)	10.40	1.13	829	1,905	-200	20.1	407.5(K-3)	4.64	-2.16	7,414
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	417.5(K+1)	8.38	-2.97	3,541	1,988	798	19.5	415.0(K+0)	7.24	-2.86	6,528
	415.0(K+0)	7.24	-2.86	6,528	4,254	591	19.7	412.5(K-1)	6.22	-2.61	5,316
	412.5(K-1)	6.22	-2.61	5,316	2,099	-83	20.0	410.0(K-2)	5.37	-2.38	10,202
	410.0(K-2)	5.37	-2.38	10,202	5,970	284	20.4	407.5(K-3)	4.64	-2.16	7,414
	407.5(K-3)	4.64	-2.16	7,414	2,707	390	20.9				

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	3,977,631	4,215.3	6,559,887	232,689	-33,114	116,209	-85,218	-14.6	134.8	-123.9	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
삼성전기	194,500	0.26	104.2	98.8	27,327	-9,105	-0.07%	-452	4,345	-3,891	2,914
하나금융지주	41,650	0.36	65.3	85.7	165,683	27,052	0.11%	3,368	-399	-2,696	-15,180
삼성전자	82,800	0.85	1,230.2	80.4	1,458,318	53,839	0.16%	10,166	24,491	-35,365	-32,124
엔씨소프트	942,000	0.43	39.1	61.1	2,518	7	-0.08%	-52	37	48	-44
SK 하이닉스	143,000	2.14	380.5	61.0	378,059	3,375	0.05%	-5,443	6,252	-1,560	-1,992
카카오	499,500	3.52	226.6	59.4	32,121	6,757	0.02%	1,128	4,695	-5,940	-1,049
KB금융	50,400	-0.59	71.4	58.8	92,499	22,465	0.15%	4,224	-2,728	-1,400	-10,332
LG 이노텍	211,500	-2.08	27.2	57.9	22,132	-2,235	-0.08%	-1,589	345	1,244	759
호텔신라	87,400	0.34	26.5	57.0	50,473	-615	-0.03%	-2,118	-299	2,418	637
NAVER	404,500	5.61	411.3	57.0	66,964	16,816	-0.01%	730	11,595	-12,589	-9,265

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터