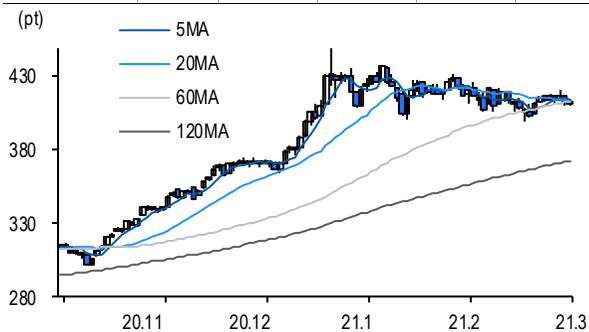


선물옵션시장 지표

2021.3.23

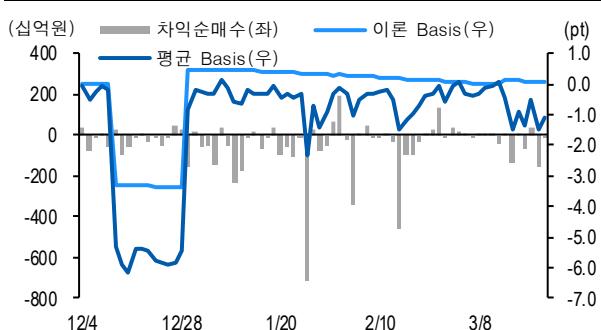
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 412.64 | -0.07 | -0.27 | 9,416.3 | - |
| 선물 6월물 | 412.40 | 0.40 | 1.65 | 19,986.3 | 226,495 |
| 선물 9월물 | 411.70 | 0.28 | 1.15 | 11.4 | 3,310 |
| 4월물(mini) | 412.40 | 0.35 | 1.42 | 2,156.2 | 34,733 |
| 5월물(mini) | 412.30 | 0.34 | 1.40 | 4.2 | 466 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|-------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.07 | -1.11 | -0.24 | -0.29% |
| 베이시스(mini) | -0.47 | -1.01 | -0.24 | -0.13% |
| 제1스프레드(SP) | 0.11 | -0.55 | -0.55 | -0.16% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | -0.47 | -0.20 | -0.20 | 0.06% |

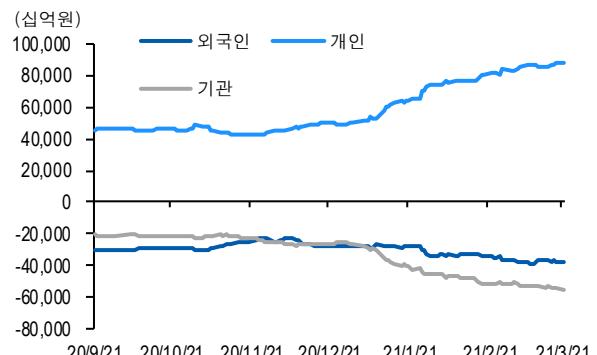


투자주체별 매매 동향 (십억원)

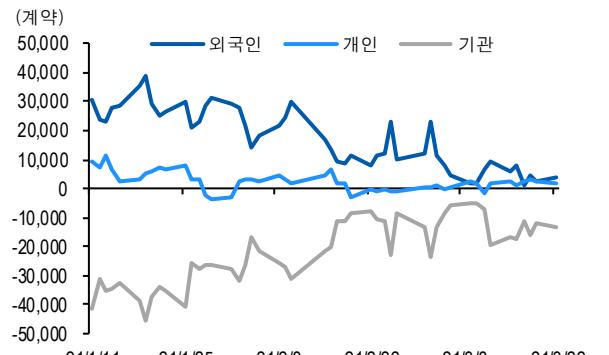
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -546.3 | 18.1 | -528.3 | -8.9 | -280.8 | 130.3 | 29.4 | -0.7 | -0.6 | -6.3 |
| 개인 | 582.6 | -6.8 | 575.7 | 0.0 | 0.9 | -49.4 | -4.3 | -0.9 | 1.3 | 23.2 |
| 기관 | -33.9 | -11.1 | -45.1 | -0.7 | -218.4 | -88.2 | -25.3 | 1.9 | -0.5 | -16.8 |
| 금융투자 | 262.8 | 6.6 | 269.4 | -20.6 | -26.3 | -238.8 | -25.5 | 1.9 | -0.6 | -12.1 |
| 투신 | -63.9 | -13.0 | -76.8 | 0.0 | -43.4 | 153.0 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 5.6 |
| 은행+보험+기타금융 | -34.4 | -14.8 | -49.2 | -1.0 | -11.1 | 4.7 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 8.4 |
| 연기금+국가지자체 | -174.4 | -1.1 | -175.5 | 20.9 | -121.0 | -7.1 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | -18.7 |
| 기타법인 | -2.3 | -0.1 | -2.4 | 0.0 | 5.3 | 7.3 | 0.2 | -0.3 | -0.2 | -0.1 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

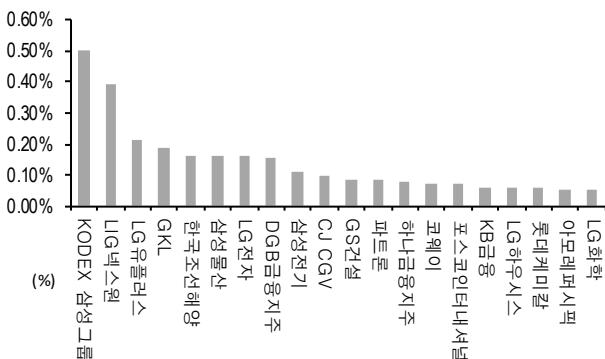
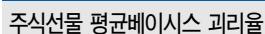
선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | | (계약, 십억원) | | | | | | |
|-----------|------------|-------|---------|--------|-----------|-----------|--------|-----------------|------------|------|--------|--------|-------|-----|------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | | | | | | | |
| Call | 515,100 | 181.7 | 620,850 | 20.5% | 지수옵션 전체 | 1,093,123 | 402.9 | 1,605,584 | | | | | | | |
| Put | 578,023 | 221.1 | 984,734 | 21.5% | PCR(금액기준) | 1.22 | VKOSPI | 23.70%(+0.09%p) | | | | | | | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | | | |
| Call | 420.0(K+3) | 4.23 | -0.10 | 13,031 | 9,102 | 107 | 20.3 | Put | 415.0(K+1) | 8.85 | -1.45 | 1,020 | 4,021 | -14 | 20.1 |
| | 417.5(K+2) | 5.22 | 0.00 | 5,100 | 4,618 | 296 | 20.6 | | 412.5(K+0) | 7.64 | -1.30 | 3,431 | 3,106 | 823 | 20.5 |
| | 415.0(K+1) | 6.27 | 0.01 | 7,457 | 3,888 | 611 | 20.7 | | 410.0(K-1) | 6.55 | -1.21 | 5,523 | 6,753 | 380 | 20.9 |
| | 412.5(K+0) | 7.58 | 0.16 | 4,894 | 3,331 | 911 | 21.2 | | 407.5(K-2) | 5.62 | -1.11 | 4,970 | 2,480 | 333 | 21.3 |
| | 410.0(K-1) | 9.00 | 0.27 | 1,448 | 2,888 | 97 | 21.6 | | 405.0(K-3) | 4.86 | -0.99 | 14,149 | 8,932 | -18 | 21.9 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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 | 4,399,380 | 3,673.3 | 6,794,138 | 175,595 | -13,291 | 45,363 | -31,192 | -6.3 | 23.2 | -16.8 | | |
| 종목명 | 선물현재가(원) | 등락률(%) | 선물거래대금(십억원) | 선현배율(%) | 미결제수량(계약) | 미결제증감(계약) | 평균괴리율(%) | 외국인순매수 | 개인순매수 | 기관순매수 | 금융투자순매수 | 연기금등순매수 |
| 한국금융지주 | 86,900 | -0.69 | 15.9 | 97.0 | 26,201 | -859 | -0.02% | -1,320 | 433 | 887 | 833 | 54 |
| NAVER | 398,500 | -0.87 | 345.5 | 96.2 | 70,302 | -64 | -0.01% | 827 | 258 | -1,090 | -622 | 241 |
| 하나금융지주 | 41,850 | -0.71 | 48.5 | 95.5 | 161,985 | -1,537 | 0.08% | 5,633 | 4,402 | -10,300 | -7,828 | -6,588 |
| 카카오 | 495,000 | 0.51 | 144.8 | 93.7 | 30,981 | 11 | -0.02% | -137 | 224 | -47 | -86 | -853 |
| 롯데케미칼 | 317,500 | 1.76 | 64.9 | 87.9 | 13,435 | 923 | 0.06% | -821 | 1,422 | -608 | 433 | -1,736 |
| 삼성전자 | 81,600 | -0.12 | 866.2 | 84.0 | 1,429,083 | 28,052 | -0.04% | 8,385 | 13,627 | -23,669 | 13,716 | -16,927 |
| 기아차 | 86,300 | -1.15 | 191.8 | 77.4 | 193,354 | -2,384 | 0.01% | -8,320 | 438 | 7,856 | 3,161 | 5,359 |
| SK 하이닉스 | 138,000 | -0.36 | 246.4 | 66.0 | 350,402 | -15,658 | -0.01% | -1,925 | -359 | 2,336 | 15,690 | -275 |
| LG 디스플레이 | 21,900 | 2.82 | 38.7 | 64.3 | 601,773 | 37,031 | -1.78% | -27,892 | 31 | 28,363 | 571 | 1,285 |
| SK 텔레콤 | 255,500 | 0.20 | 21.1 | 62.7 | 22,267 | -413 | 0.00% | -197 | -368 | 565 | 293 | 272 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터