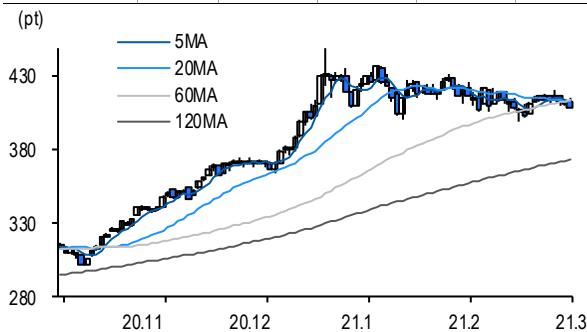


선물옵션시장 지표

2021.3.24

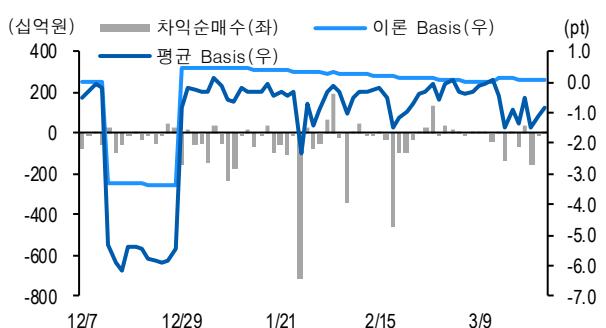
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	408.71	-0.95	-3.93	10,532.3	-
선물 6월물	408.15	-1.03	-4.25	22,287.1	236,906
선물 9월물	407.45	-1.03	-4.25	10.7	3,324
4월물(mini)	408.12	-1.04	-4.28	2,124.3	45,019
5월물(mini)	407.84	-1.08	-4.46	6.4	632



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.05	-0.84	-0.56	-0.22%
베이시스(mini)	-0.48	-0.76	-0.59	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.11	-0.54	-0.50	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.48	-0.54	-0.54	-0.02%



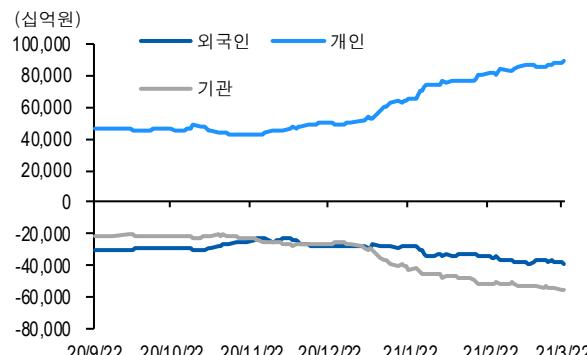
투자주체별 매매 동향

(십억원)

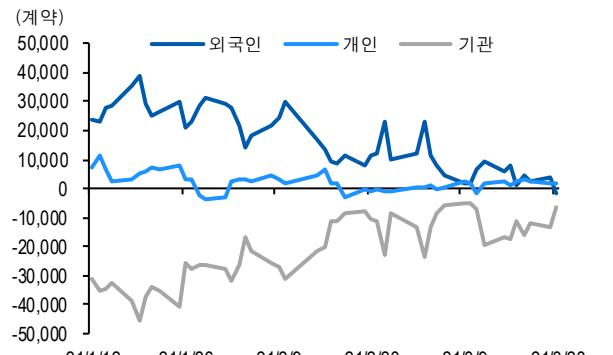
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-477.3	-2.0	-479.3	-1.5	-248.2	-571.7	-50.3	-6.6	4.6	-26.8
개인	1,017.3	80.3	1,097.6	0.0	3.2	-68.3	56.8	4.9	0.1	-51.3
기관	-540.8	-88.2	-629.0	4.3	-181.4	649.5	-10.2	2.0	-4.0	82.2
금융투자	-69.1	-83.2	-152.3	2.3	-3.8	903.4	-9.5	2.4	-3.8	98.0
투신	-82.8	0.5	-82.3	0.0	-13.7	-247.5	-0.8	-0.4	0.3	-75.7
은행+보험+기타금융	-17.8	-6.3	-24.1	0.0	-3.5	-15.8	0.1	-0.1	-0.5	3.4
연기금+국가지자체	-339.9	-1.4	-341.3	2.0	-159.7	9.3	0.0	0.0	0.0	56.6
기타법인	0.8	9.9	10.7	0.0	1.1	-9.4	3.8	-0.3	-0.7	-4.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

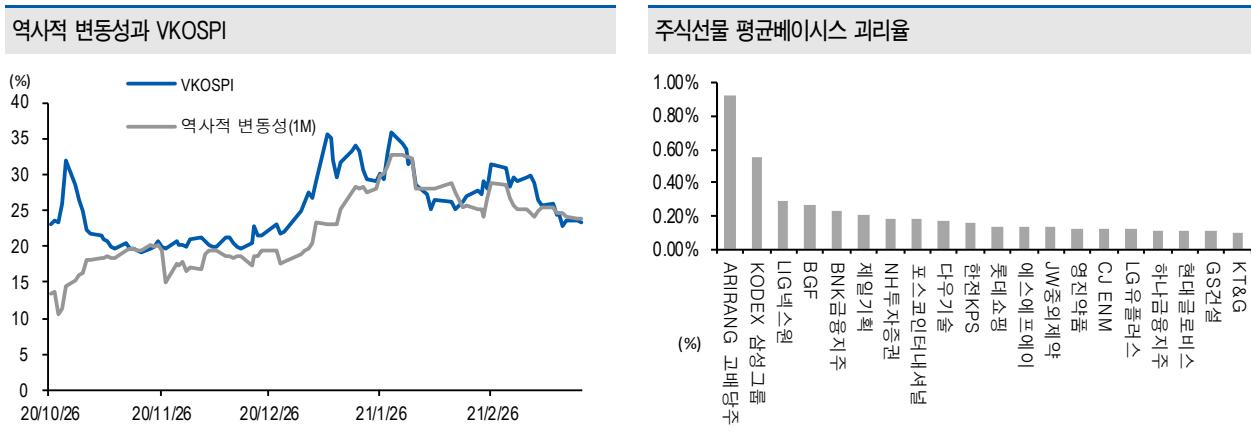


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	633,489	201.1	669,444	19.7%	지수옵션 전체		1,303,286	479.6	1,687,237		
Put	669,797	278.6	1,017,793	20.5%	PCR(금액기준)		1.39	VKOSPI	23.19%(-0.51%p)		
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)
Call	420.0(K+3)	2.62	-1.61	28,614	10,639	1,537	19.6	Put	415.0(K+1)	10.90	2.05
	417.5(K+2)	3.31	-1.91	12,129	5,757	1,139	19.7		412.5(K+0)	9.36	1.72
	415.0(K+1)	4.08	-2.19	8,638	5,742	1,854	19.6		410.0(K-1)	8.00	1.45
	412.5(K+0)	5.03	-2.55	5,214	4,266	935	19.7		407.5(K-2)	6.79	1.17
	410.0(K-1)	6.16	-2.84	2,799	3,094	206	19.9		405.0(K-3)	5.75	0.89

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	4,058,361	3,601.3	6,838,948	44,810	-49,318	-92,355	147,006	-26.8	-51.3	82.2		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	204,000	-3.32	45.2	84.3	15,043	-6,979	-0.25%	1,583	124	-1,707	1,033	1,847
롯데케미칼	310,000	-2.36	50.6	78.5	14,159	724	0.02%	-507	769	-265	-137	-73
삼성전자	81,400	-0.25	836.6	77.1	1,442,494	13,411	0.03%	-19,747	-24,417	46,721	14,568	16,100
카카오	490,000	-1.01	143.7	76.8	31,511	530	-0.01%	273	114	-407	-177	-147
한국금융지주	87,000	0.12	12.1	70.5	26,088	-113	0.00%	-324	-139	463	1,170	-707
기아차	83,300	-3.48	193.7	70.3	167,989	-25,365	-0.02%	4,021	-14,494	10,473	10,897	11,228
하나금융지주	41,200	-1.55	37.9	67.6	162,100	115	0.11%	1,862	4,532	-6,863	-4,870	-1,932
LG 디스플레이	21,900	0.00	70.6	67.3	641,883	40,110	-2.00%	-44,112	-2,426	46,536	21,496	8,076
NAVER	385,500	-3.26	273.1	66.1	65,116	-5,186	-0.03%	-361	-318	842	769	3,585
한국조선해양	115,500	-1.70	24.0	62.7	11,967	-10,706	-0.29%	-815	-303	1,118	1,848	5,716

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터