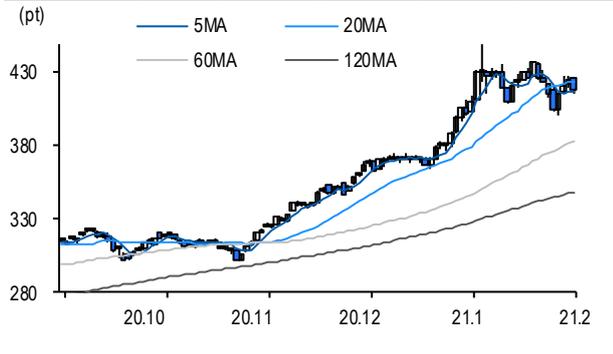
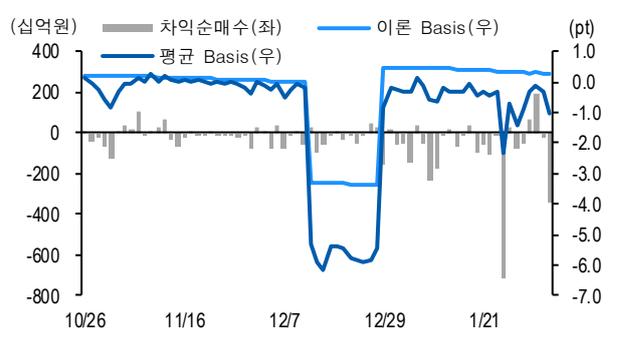


선물옵션시장 지표 2021.2.5

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	418.31	-1.62	-6.90	15,569.9	-
선물 3월물	417.05	-1.94	-8.25	38,041.9	236,987
선물 6월물	416.65	-1.91	-8.10	46.5	20,313
2월물(mini)	417.48	-1.90	-8.10	5,573.6	99,556
3월물(mini)	417.00	-1.95	-8.18	191.1	39,000

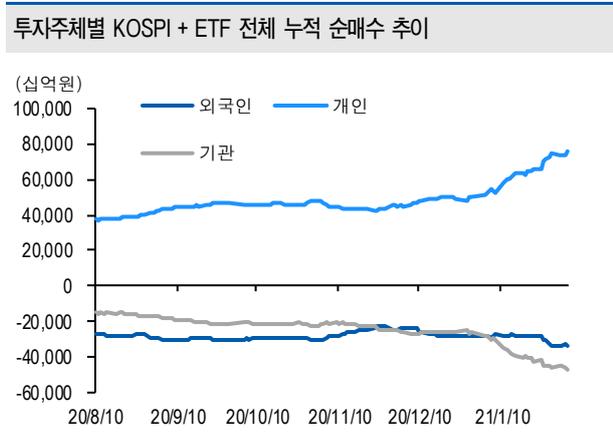


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.29	-1.01	-1.26	-0.31%	
베이스스(mini)	0.05	-0.48	-0.83	-0.13%	
제1스프레드(SP)	0.15	-0.55	-0.55	-0.17%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	-0.83	-0.83	-0.21%	

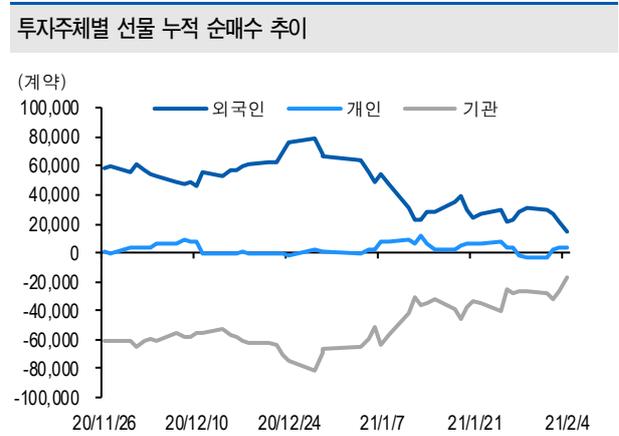


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-640.0	-18.3	-658.2	-11.2	-622.8	-501.8	-277.7	0.0	4.8	-123.3
개인	2,471.4	109.2	2,580.6	0.0	22.7	-52.8	4.9	1.8	0.6	-35.3
기관	-1,836.0	-85.7	-1,921.7	-330.3	-332.5	770.1	264.9	-0.1	-4.1	160.6
금융투자	-1,280.7	-154.8	-1,435.5	-255.5	-96.3	1,148.0	274.3	-0.2	-4.2	130.9
투신	-109.0	-9.8	-118.8	-53.4	-10.1	-422.7	-0.2	-0.4	0.1	-16.0
은행+보험+기타금융	-27.9	67.7	39.8	0.0	-13.6	25.7	-9.3	0.6	0.0	2.8
연기금+국가자재	-375.6	3.3	-372.4	-21.5	-192.4	19.1	0.0	0.0	0.0	42.9
기타법인	4.6	-5.2	-0.7	0.0	2.3	-215.5	8.0	-1.7	-1.2	-2.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,223,423	355.2	754,243	26.4%	지수옵션 전체	2,793,062	923.4	2,377,377
Put	1,569,639	568.3	1,623,134	29.9%	PCR(금액기준)	1.60	VKOSPI	32.06%(+0.77%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	432.5(K+3)	1.57	-2.43	55,087	8,618	1,717	26.6	Put	427.5(K+1)	12.40	4.52	360	3,027	-5	29.5
	430.0(K+2)	2.02	-2.88	73,430	11,787	1,402	26.3		425.0(K+0)	10.80	4.18	1,366	3,779	57	30.0
	427.5(K+1)	2.58	-3.39	33,957	6,015	535	26.1		422.5(K-1)	9.16	3.62	2,572	4,003	-154	29.7
	425.0(K+0)	3.28	-3.95	28,144	8,025	325	25.9		420.0(K-2)	7.71	3.07	5,609	4,745	-136	29.6
	422.5(K-1)	4.15	-4.48	14,442	4,684	142	25.8		417.5(K-3)	6.46	2.58	15,111	4,201	-148	29.8

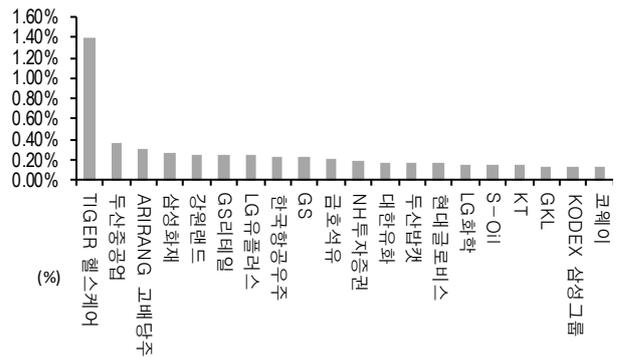
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



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	6,709,076	6,879.7	7,915,959	67,468	-95,290	17,551	83,815	-123.3	-35.3	-55.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	317,500	-0.47	384.6	91.1	60,507	1,384	0.07%	-1,962	-157	2,202	-381	787
현대차	248,500	0.81	418.0	88.3	63,705	-3,847	0.07%	-1,035	-1,836	2,871	-572	1,394
LG 화학	1,004,000	0.20	363.7	83.3	18,491	1,839	0.16%	-1,418	-1,736	3,166	1,010	171
카카오	455,000	-1.73	194.0	82.8	28,023	-4,024	0.02%	-2,551	129	2,365	781	1,757
SK 하이닉스	125,000	-4.21	436.1	75.6	331,329	-39,765	-0.03%	-9,970	939	9,996	29,921	8,976
삼성전기	207,000	-1.66	103.6	74.2	37,194	-509	0.07%	-297	-487	763	528	1,070
LG 이노텍	211,000	-2.09	48.1	72.5	22,406	-88	-0.18%	-1,762	1,507	-95	-458	615
호텔신라	81,200	-0.25	32.6	70.9	23,221	-2,716	0.07%	2,858	-1,015	-1,893	-1,335	-1,807
DGB 금융지주	6,550	-1.50	1.4	69.2	5,470	408	-0.11%	674	-903	229	229	0
하나금융지주	34,150	-2.15	46.5	69.1	107,400	-792	0.11%	-9,651	3,758	5,893	1,247	3,646

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터