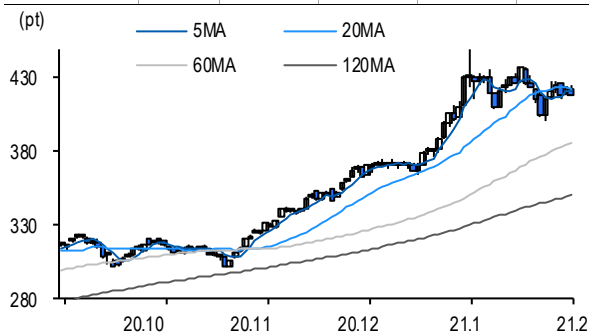


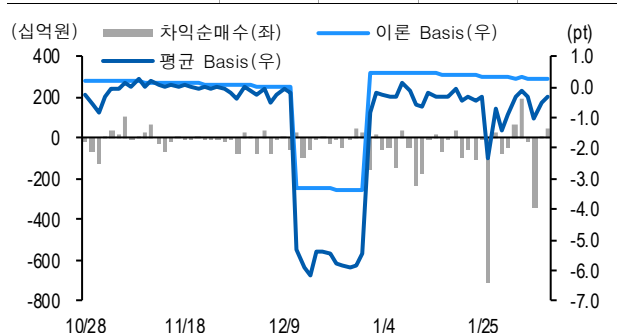
선물옵션시장 지표

2021.2.9

Market Data	(십억원, 계약)				
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	418.95	-1.03	-4.35	14,582.5	-
선물 3월물	418.50	-0.95	-4.00	29,423.8	231,862
선물 6월물	417.90	-0.97	-4.10	110.3	22,105
2월물(mini)	418.86	-0.96	-4.06	4,063.4	105,276
3월물(mini)	418.78	-0.88	-4.02	383.7	45,793



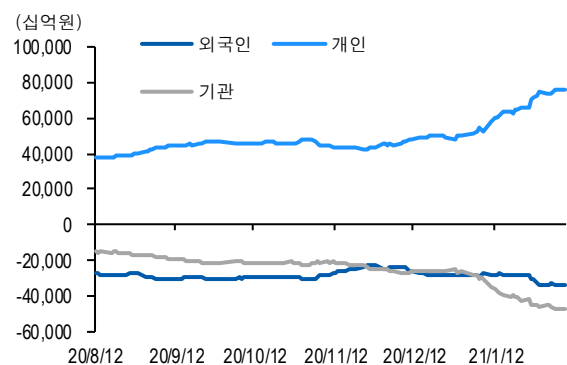
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.26	-0.29	-0.45	-0.13%
베이스(mini)	0.02	-0.01	-0.09	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.15	-0.64	-0.70	-0.19%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.13	-0.13	-0.04%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.5	-0.6	-359.2	38.8	-337.8	59.1	300.7	-2.8	0.6	-5.9
개인	85.6	102.4	187.9	0.0	2.4	206.5	26.4	3.4	-1.8	-41.6
기관	279.9	-105.2	174.7	4.4	-75.9	-121.8	-327.1	-0.6	2.2	49.3
금융투자	529.6	-220.5	309.1	0.0	2.1	132.3	-326.8	1.5	0.8	60.8
투신	-9.2	0.3	-8.9	0.0	-7.2	-253.9	-0.4	-0.7	0.0	-25.3
은행+보험+기타금융	-27.5	123.9	96.5	0.0	-28.7	-1.6	0.1	-1.4	1.4	-0.7
연기금+국가자재	-220.6	3.9	-216.7	4.4	-58.4	1.4	-0.1	0.0	0.0	14.5
기타법인	-7.0	3.5	-3.5	0.0	-0.1	-143.8	0.1	0.0	-1.0	-1.9

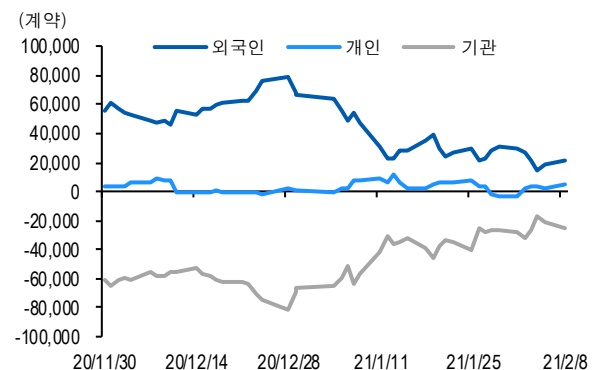
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향													(계약, 십억원)				
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정			
Call	1,907,181		434.7		843,682		24.5%			지수옵션 전체		4,097,098		947.5		2,572,714	
Put	2,189,917		512.7		1,729,032		24.8%			PCR(금액기준)		1.18		VKOSPI		27.33%(−1.32%p)	
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		
Call	430.0(K+3)	0.60	−1.65	197,967	17,908	4,876	25.0	Put	425.0(K+1)	7.57	1.50	5,647	4,421	678	25.1		
	427.5(K+2)	0.91	−2.10	128,402	11,066	3,310	24.3		422.5(K+0)	5.74	0.96	24,919	5,313	1,213	24.4		
	425.0(K+1)	1.37	−2.61	96,721	10,948	1,945	23.7		420.0(K−1)	4.20	0.51	72,626	6,565	895	24.2		
	422.5(K+0)	2.06	−3.10	48,669	7,578	−1,351	23.3		417.5(K−2)	2.99	0.15	90,459	5,737	1,033	24.3		
	420.0(K−1)	3.02	−3.58	16,935	6,725	567	23.1		415.0(K−3)	2.09	−0.08	158,692	7,024	703	24.8		

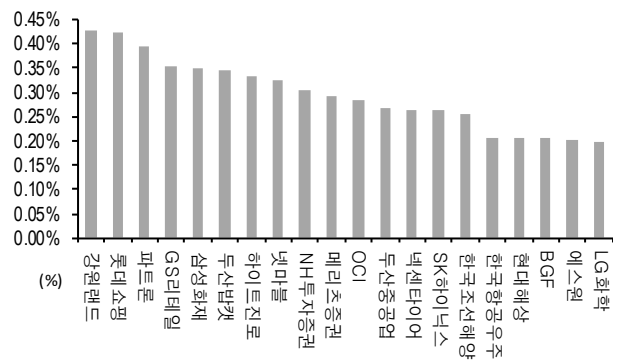
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,476,565	5,525.9	8,076,194	22,600	-6,810	-88,918	95,063	-5.9	-41.6	49.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	205,000	-3.30	37.7	97.3	19,802	-762	-0.16%	-1,176	518	658	222	948
카카오	458,000	0.66	178.5	76.0	17,170	-8,680	0.08%	1,790	859	-2,624	-251	-2,469
삼성전기	204,000	-1.69	61.1	74.6	29,915	-1,446	0.14%	-1,309	1,294	12	525	-118
GS 건설	40,150	-0.50	19.0	68.4	107,371	-35,109	-0.06%	739	-646	-268	-442	517
SK 하이닉스	125,500	-1.57	221.6	62.1	334,776	-2,258	0.26%	-6,095	7,893	-2,060	-4,958	180
NAVER	357,000	-1.65	153.3	59.8	48,216	-6,450	0.01%	54	307	-363	-1,384	3,970
LG 디스플레이	22,950	0.22	37.5	58.6	495,717	-100,172	-0.66%	8,443	-1,866	-6,577	3,147	-3,760
SK 텔레콤	252,500	-2.70	43.8	57.0	30,693	-2,022	0.08%	-1,109	400	703	-277	1,254
삼성전자	83,200	-0.24	705.4	55.7	837,075	-228,624	0.01%	4,133	-18,031	13,642	14,018	-15,630
LG 화학	995,000	-3.40	159.8	55.6	15,082	-3,334	0.20%	-678	1,082	-406	12	-908

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터