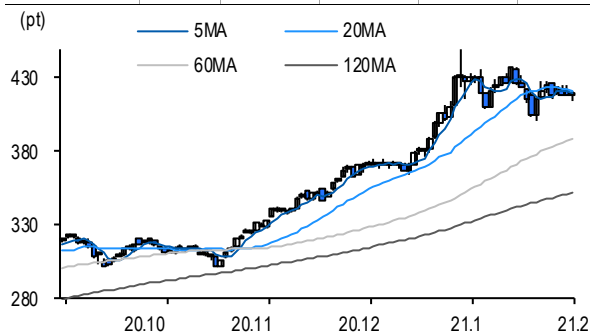


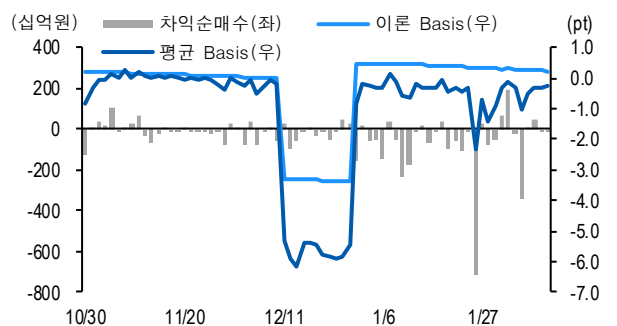
## 선물옵션시장 지표

2021.2.15

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	419.65	0.42	1.74	12,838.4	-
선물 3월물	421.25	0.99	4.15	28,718.2	223,612
선물 6월물	419.90	0.77	3.20	52.0	22,645
2월물(mini)	420.92	0.83	3.48	2,996.9	0
3월물(mini)	421.30	1.01	4.40	1,078.1	63,641



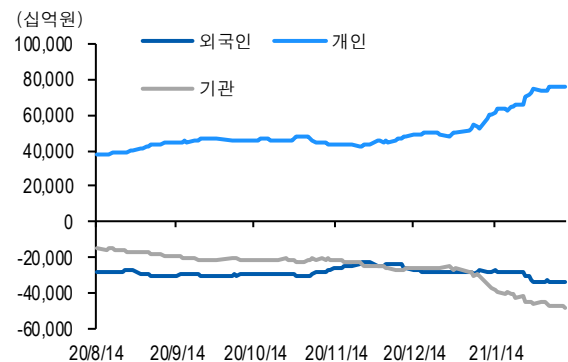
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.24	-0.25	1.60	-0.12%
베이스(mini)	0.00	-0.01	1.27	0.00%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.65	-0.70	-0.19%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	1.28	1.28	0.31%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	753.4	-3.6	749.8	-1.5	589.3	595.0	-28.4	-10.0	4.7	6.9
개인	133.3	-9.5	123.8	0.0	1.9	-163.2	-17.2	14.8	0.0	-67.4
기관	-920.9	3.8	-917.1	-2.4	-444.6	-519.6	52.5	-4.9	-4.3	65.0
금융투자	-531.8	-81.7	-613.5	-17.0	-426.6	-778.5	72.8	1.5	-4.4	96.5
투신	-5.7	9.7	4.0	0.0	14.9	280.8	-0.2	-2.9	0.2	30.1
은행+보험+기타금융	-48.7	74.0	25.3	0.0	-14.3	-27.3	-7.7	-3.0	-0.2	-0.4
연기금+국가자재	-322.4	-0.1	-322.5	14.6	-25.7	5.4	-12.5	-0.5	0.1	-61.2
기타법인	34.3	9.2	43.5	0.0	4.8	87.8	-7.0	0.0	-0.5	-4.4

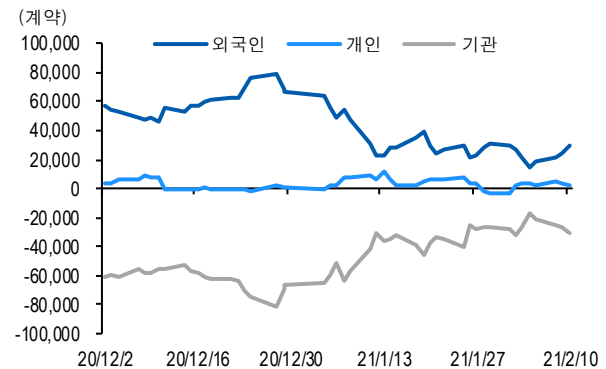
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

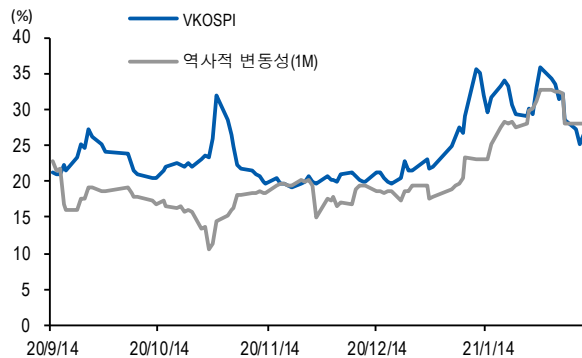
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,307,806	441.8	498,143	14.8%	지수옵션 전체	4,672,772	806.8	1,411,821
Put	2,364,966	365.0	913,678	11.1%	PCR(금액기준)	0.83	VKOSPI	26.43%(+1.22%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	0.01	-0.27	317,768	0	-17,629	10.7	Put	420.0(K+1)	0.17	-3.60	211,789	0	-8,234	1.4
	422.5(K+2)	0.05	-0.57	544,227	0	-12,497	8.4		417.5(K+0)	0.01	-2.30	408,453	0	-7,507	5.0
	420.0(K+1)	1.11	-0.13	532,229	0	-10,730	14.5		415.0(K-1)	0.01	-1.40	440,886	0	-10,795	9.6
	417.5(K+0)	3.44	1.10	281,058	0	-6,525	25.1		412.5(K-2)	0.01	-0.76	374,786	0	-8,867	14.1
	415.0(K-1)	6.00	2.12	78,430	0	-4,365	36.0		410.0(K-3)	0.01	-0.43	285,476	0	-13,946	18.3

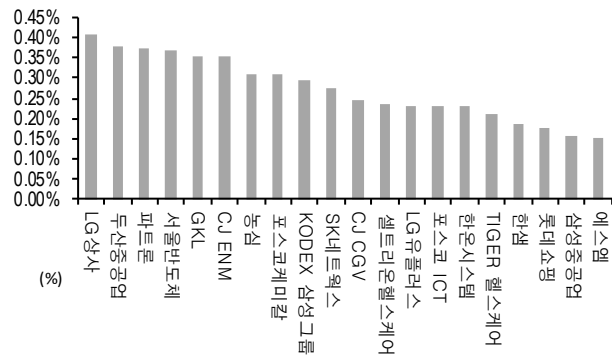
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	6,742,694	7,179.1	6,336,783	-1,885,986	-15,291	-65,721	85,197	6.9	-67.4	65.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	126,500	0.40	377.8	71.1	0	-366,525	-0.11%	-548	-8,026	9,014	18,734	-1,566
이마트	172,500	0.58	24.3	62.8	0	-14,802	-0.24%	-909	1,734	-825	318	904
기업은행	8,480	1.07	6.9	51.1	0	-53,773	0.14%	2,204	-1,256	-948	-229	-16,231
아모레퍼시픽	231,500	2.43	25.6	44.7	0	-12,976	0.12%	-191	-345	605	651	-574
농심	291,500	0.00	4.0	44.4	0	-1,395	0.31%	19	29	-48	-47	-414
하나금융지주	36,800	1.38	22.1	44.2	0	-66,975	-0.06%	4,217	312	-4,529	-1,689	2,377
현대제철	41,100	2.11	12.5	41.4	0	-24,224	-0.03%	-146	-771	915	-5,594	-1,189
호텔신라	82,300	0.98	12.4	40.9	0	-17,410	-0.01%	52	1,043	-1,095	1,274	-2,640
LG 상사	27,550	4.16	3.6	39.7	0	-10,381	0.41%	-16	-525	541	462	-6,030
셀트리온헬스케어	142,500	0.49	47.1	39.6	0	-40,162	0.24%	554	-1,176	749	-1,274	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표