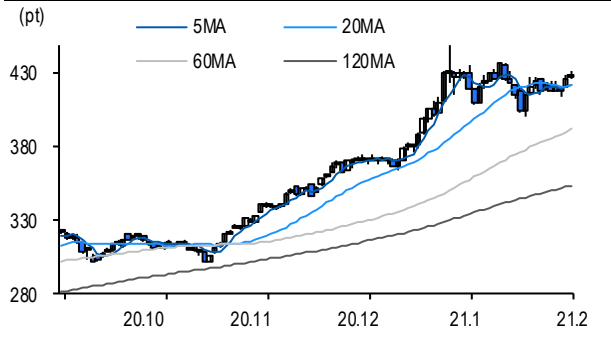
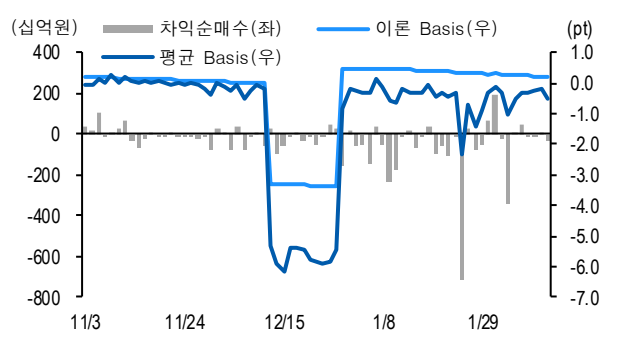


선물옵션시장 지표 2021.2.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.24	0.52	2.23	11,229.9	-
선물 3월물	428.00	0.34	1.45	25,200.1	223,907
선물 6월물	427.40	0.35	1.50	208.4	24,571
3월물(mini)	428.18	0.38	1.60	4,282.0	71,087
4월물(mini)	427.60	0.42	1.80	108.0	2,071

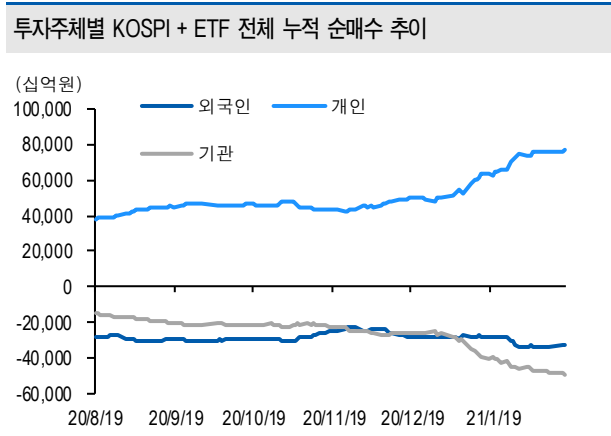


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.20	-0.53	-1.24	-0.17%
베이스스(mini)	0.20	-0.53	-1.06	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.17	-0.69	-0.70	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	0.20	-1.06	-1.06	-0.29%

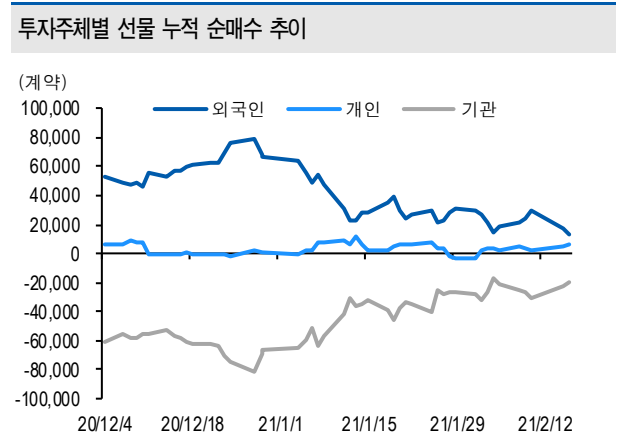


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	234.9	11.5	246.4	1.4	157.5	-130.3	-229.5	6.5	-2.0	-35.5
개인	423.4	96.8	520.2	0.0	3.7	176.9	17.9	-9.3	-0.9	43.2
기관	-675.0	-118.0	-793.0	-32.0	-202.7	-53.3	211.0	2.5	3.4	-14.2
금융투자	-310.5	-23.8	-334.3	-12.9	-15.6	271.6	210.6	1.6	3.4	-1.6
투신	-7.5	-23.7	-31.1	0.0	1.2	-304.6	0.5	-0.1	0.0	-20.4
은행+보험+기타금융	-56.5	-92.1	-148.5	-11.8	-53.9	-6.1	-0.1	1.0	0.0	0.9
연기금+국가자재	-280.2	0.2	-280.0	-7.4	-124.0	-14.3	0.0	0.0	0.0	6.9
기타법인	16.7	9.6	26.3	0.0	-1.4	6.8	0.6	0.3	-0.4	6.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	595,611	309.1	528,968	20.5%	지수옵션 전체	1,394,663	593.4	1,592,925
Put	799,052	284.3	1,063,957	23.7%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	25.08%(-1.14%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	6.55	-0.28	4,900	2,444	371	20.5	Put	430.0(K+1)	10.40	-1.85	1,397	2,391	624	23.0
	432.5(K+2)	7.52	-0.23	1,977	2,293	338	20.3		427.5(K+0)	9.37	-1.58	1,627	1,030	365	23.5
	430.0(K+1)	8.67	-0.14	4,149	5,799	-359	20.4		425.0(K-1)	8.23	-1.49	2,697	1,621	340	23.6
	427.5(K+0)	10.05	0.05	1,004	1,844	359	20.6		422.5(K-2)	7.23	-1.34	1,575	877	97	23.7
	425.0(K-1)	11.50	0.25	510	2,614	39	20.8		420.0(K-3)	6.33	-1.25	4,237	5,722	65	23.9

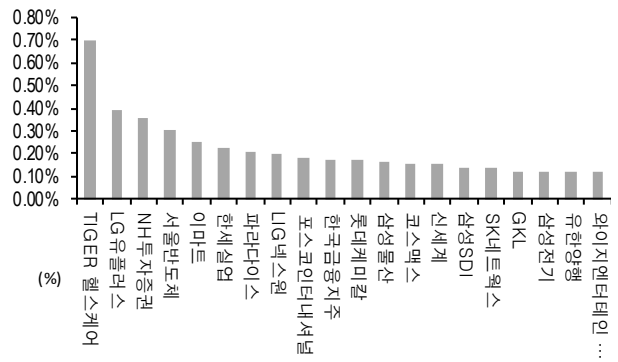
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,444,984	4,825.4	6,891,002	163,023	-25,367	65,711	-40,721	-35.5	43.2	-14.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	211,500	-0.47	29.0	85.7	26,666	338	-0.10%	452	671	-1,122	-141	-277
엔씨소프트	1,017,000	1.50	70.1	83.7	3,500	260	0.02%	509	47	-556	-285	-271
삼성전기	202,000	-0.49	73.2	83.3	37,051	1,171	0.12%	-1,140	919	221	-948	518
SK 하이닉스	132,500	-0.38	320.7	75.7	438,587	-5,183	0.10%	-4,362	1,137	3,311	7,112	2,126
삼성전자	84,900	0.59	1,275.9	73.5	1,323,383	12,663	0.08%	-18,408	-6,445	19,211	-18,608	8,167
NAVER	394,000	1.94	422.2	71.3	84,073	558	0.06%	-2,719	2,673	45	-1,922	2,855
현대건설	43,200	-0.12	17.0	70.9	15,330	565	-0.05%	-212	638	-212	483	-695
롯데케미칼	312,500	1.63	52.5	69.3	16,897	2,172	0.17%	1,197	173	-1,401	-2,509	-767
하나금융지주	37,100	0.41	33.0	68.8	140,499	-225	0.08%	3,958	-2,710	-1,348	-1,135	-213
SK 이노베이션	285,000	0.00	258.0	68.4	45,073	-3,101	-0.02%	-521	-725	1,245	3,597	846

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

