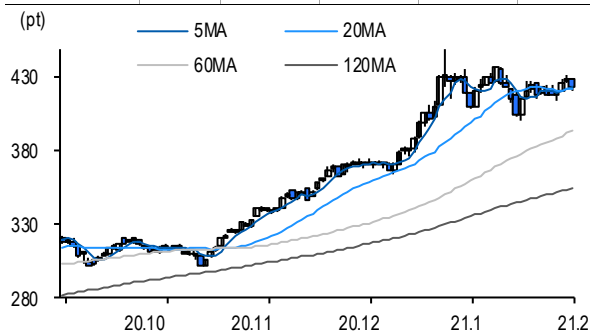


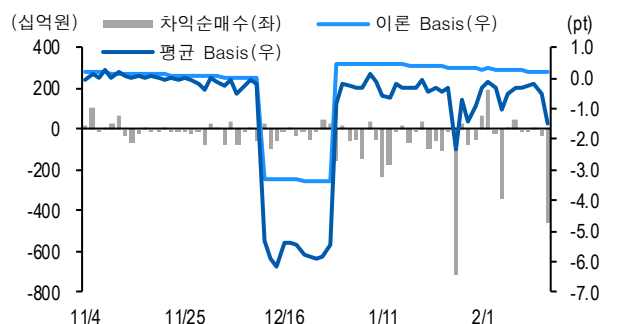
선물옵션시장 지표

2021.2.18

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.20	-1.17	-5.04	11,130.9	-
선물 3월물	423.45	-1.06	-4.55	25,536.4	227,403
선물 6월물	422.65	-1.11	-4.75	198.9	25,415
3월물(mini)	423.18	-1.13	-5.00	3,263.4	76,378
4월물(mini)	422.52	-1.19	-5.08	51.5	3,686



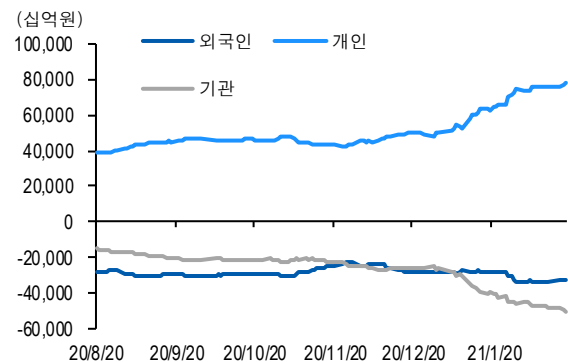
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.19	-1.45	-0.75	-0.39%
베이스(mini)	0.19	-1.45	-1.02	-0.39%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.68	-0.65	-0.20%
합성선물 베이스(ATM)	0.19	-0.94	-0.94	-0.27%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-509.1	-9.7	-518.8	-121.3	-419.9	-288.5	-126.6	-5.0	8.3	-79.3
개인	1,837.7	46.5	1,884.2	0.0	-1.0	-505.9	-18.3	1.3	-2.5	-34.2
기관	-1,346.0	-35.2	-1,381.1	-339.0	-536.1	793.1	144.8	4.1	-5.0	114.6
금융투자	-849.3	-102.8	-952.1	-291.5	-292.9	844.6	144.7	1.6	-2.1	111.9
투신	-64.9	-28.1	-93.0	-10.1	-0.6	-135.7	0.1	0.0	0.0	-14.9
은행+보험+기타금융	-7.2	75.3	68.2	0.0	-6.2	-37.6	0.0	2.5	-2.9	0.1
연기금+국가자재	-353.8	-3.1	-356.9	-33.3	-184.8	121.7	0.0	0.0	0.0	17.5
기타법인	17.4	-1.6	15.8	0.0	-1.9	1.4	0.1	-0.4	-0.8	-1.1

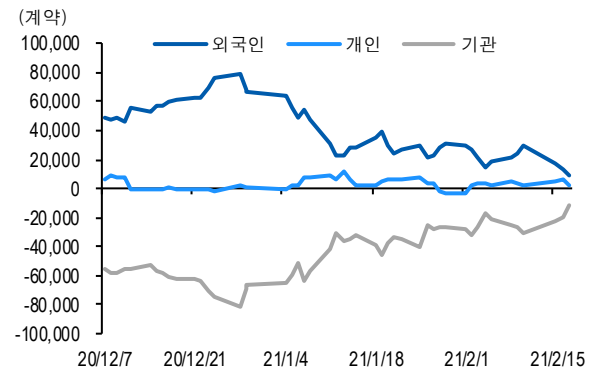
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	483,931	208.0	548,217	21.1%	지수옵션 전체	1,177,725	484.6	1,645,029
Put	693,794	276.6	1,096,812	23.4%	PCR(금액기준)	1.33	VKOSPI	25.58%(+0.50%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	4.06	-1.61	13,372	2,700	560	21.2	Put	432.5(K+1)	15.05	3.30	38	503	7	24.5
	435.0(K+2)	4.74	-1.81	7,013	2,503	59	21.1		430.0(K+0)	13.20	2.80	451	2,404	13	23.7
	432.5(K+1)	5.54	-1.98	6,206	2,797	504	21.0		427.5(K-1)	11.60	2.23	457	1,125	95	23.4
	430.0(K+0)	6.46	-2.21	5,401	6,009	210	21.0		425.0(K-2)	10.25	2.02	1,093	1,935	314	23.4
	427.5(K-1)	7.45	-2.60	1,986	2,141	297	20.9		422.5(K-3)	9.01	1.78	1,999	1,160	283	23.4

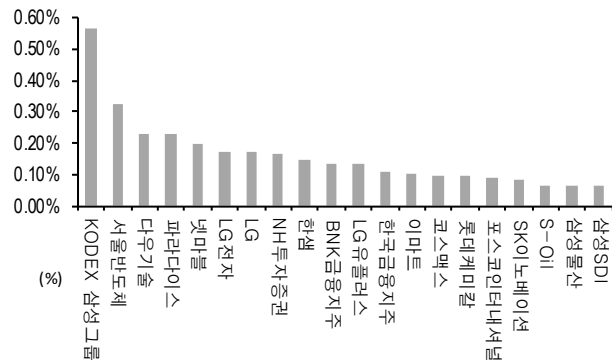
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,837,269	4,764.8	7,064,728	173,726	-58,308	-16,300	75,103	-79.3	-34.2	114.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	201,500	-0.25	106.2	91.2	36,563	-488	0.02%	529	-5,808	5,329	3,171	2,918
NAVER	394,000	0.00	393.8	86.9	83,219	-854	0.01%	-456	-5,370	5,830	4,587	1,676
SK 하이닉스	130,500	-1.51	370.0	79.3	418,366	-20,221	-0.04%	-2,323	-3,860	6,329	16,312	3,348
LG 이노텍	217,000	2.60	48.1	78.9	28,645	1,979	-0.12%	357	1,791	-2,259	-1,113	-1,077
SK 이노베이션	298,000	4.56	404.0	74.0	62,252	17,179	0.08%	-1,395	2,757	-1,466	-6,350	-6,007
POSCO	270,000	-0.74	80.5	71.3	8,002	-425	-0.07%	-1,513	241	1,245	-66	688
하나금융지주	37,900	2.16	58.1	71.0	144,301	3,802	0.02%	-1,698	-1,770	3,751	-4,828	3,656
삼성 SDI	805,000	0.00	178.0	69.4	25,207	479	0.06%	-1,080	543	469	52	584
삼성전자	83,200	-2.00	1,037.4	68.3	1,236,419	-86,964	-0.11%	-41,958	-14,466	59,092	55,861	14,568
LG 디스플레이	24,700	0.00	45.9	66.8	560,498	-3,908	-0.66%	15,912	-2,518	-13,394	-16,521	-4,600

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터