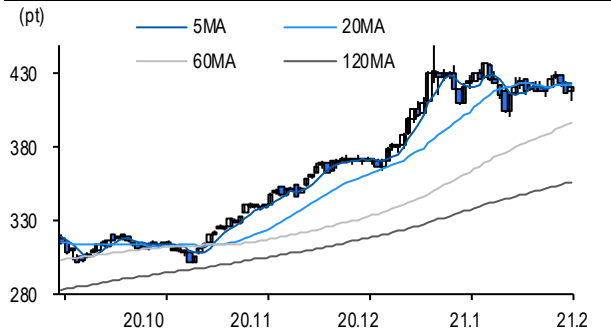
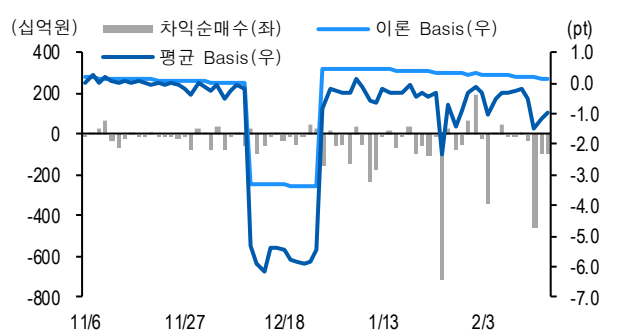


선물옵션시장 지표 2021.2.22

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	420.94	0.84	3.50	12,502.6	-	
선물 3월물	421.45	0.98	4.10	32,789.0	234,346	
선물 6월물	420.35	0.95	3.95	301.1	28,031	
3월물(mini)	421.40	0.97	4.14	4,498.6	72,275	
4월물(mini)	420.48	0.91	3.78	149.7	10,254	

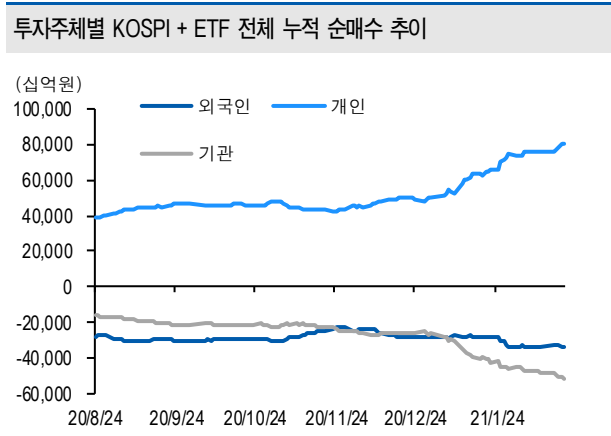


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.17	-0.94	0.51	-0.26%	
베이스스(mini)	0.17	-0.95	0.46	-0.27%	
제1스프레드(SP)	0.17	-0.75	-0.75	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.17	0.11	0.11	-0.01%	

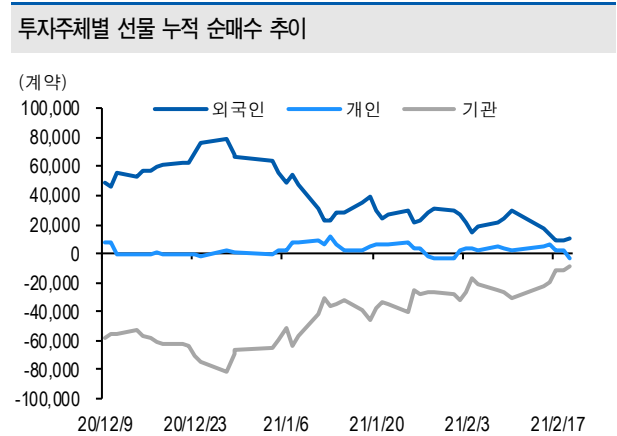


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-352.6	-25.7	-378.2	-62.5	63.1	114.9	137.2	-6.6	5.0	5.0	
개인	435.6	13.6	449.2	0.0	-7.5	-451.5	-61.4	4.2	-0.7	-34.4	
기관	-72.7	34.1	-38.6	-34.7	-94.9	350.7	-75.5	2.0	-4.6	34.0	
금융투자	117.1	-181.1	-64.0	-47.7	-37.6	-159.7	-76.4	2.3	-4.5	6.5	
투신	-24.4	38.2	13.8	0.0	-2.0	518.8	0.8	-0.3	0.0	81.0	
은행+보험+기타금융	-24.8	171.3	146.5	0.0	-12.9	12.3	0.1	0.0	-0.1	2.8	
연기금+국가자재	-85.6	0.4	-85.2	13.0	-32.1	-20.6	0.0	0.0	0.0	-56.3	
기타법인	-10.3	-22.1	-32.4	0.0	-0.6	-14.1	-0.3	0.4	0.3	-4.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





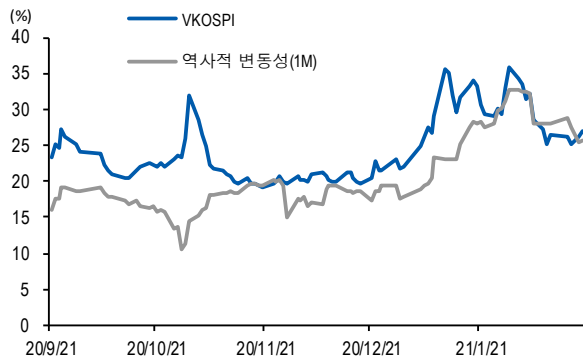
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,067,111	445.2	608,080	23.3%	지수옵션 전체	2,323,934	984.7	1,831,945
Put	1,256,823	539.5	1,223,865	24.5%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	26.86%(+0.76%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	7.61	1.91	16,167	3,824	625	23.3	Put	420.0(K+1)	8.75	-1.70	1,097	6,050	530	23.1
	422.5(K+2)	8.78	2.10	4,165	2,065	25	23.4		417.5(K+0)	7.70	-1.51	2,759	2,009	564	23.4
	420.0(K+1)	10.15	2.37	7,281	6,819	1,732	23.8		415.0(K-1)	6.79	-1.30	5,582	3,125	518	23.9
	417.5(K+0)	11.25	2.20	3,972	2,812	654	23.3		412.5(K-2)	5.96	-1.13	7,401	1,753	-370	24.2
	415.0(K-1)	13.20	2.70	2,689	1,422	679	24.6		410.0(K-3)	5.28	-0.99	14,869	5,885	-1,662	24.8

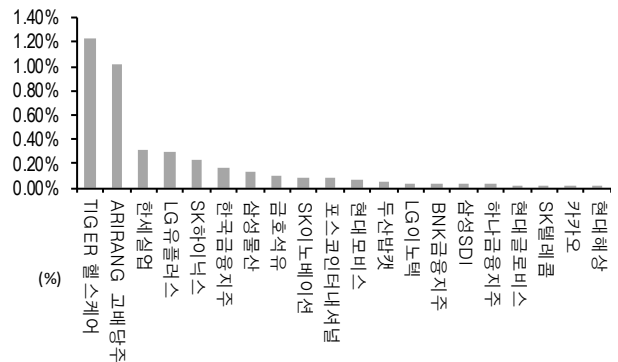
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,233,164	6,119.6	7,191,155	144,616	-7,501	-60,627	75,573	5.0	-34.4	34.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	997,000	0.10	88.8	109.0	3,048	-416	-0.03%	-292	-126	418	581	60
하나금융지주	37,150	1.50	53.0	98.8	147,846	3,278	0.03%	2,105	-2,159	106	-1,011	-2,066
SK 이노베이션	297,000	0.17	283.6	98.7	76,010	5,673	0.09%	-1,885	1,994	-4	-4,433	-319
NAVER	397,500	2.32	374.7	91.7	79,925	-1,073	-0.01%	-121	1,386	-1,272	1,399	-1,266
KB 금융	43,650	-0.23	86.5	88.4	71,137	9,688	0.00%	-10,952	1,348	8,689	2,105	3,338
현대건설	42,000	1.94	21.2	79.7	15,220	753	-0.36%	-789	209	578	127	322
이마트	183,000	1.39	43.7	78.1	20,644	-3,707	-0.05%	1,150	-1,288	127	1,437	1,501
카카오	505,000	0.80	266.8	77.5	29,379	974	0.02%	240	1,668	-1,947	-1,241	-793
현대차	242,000	3.20	214.4	77.0	69,198	2,260	-0.11%	-893	-406	1,303	-762	-1,705
현대모비스	322,500	1.74	159.3	75.4	15,739	3,892	0.06%	67	-654	578	-360	-3,276

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터