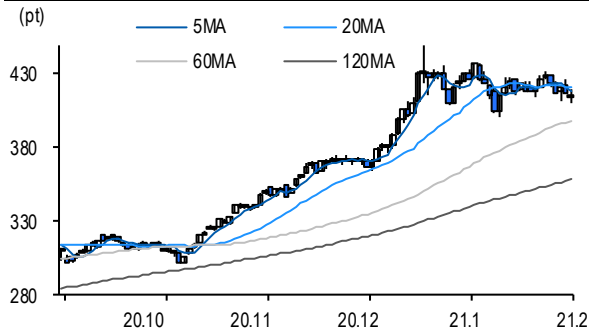
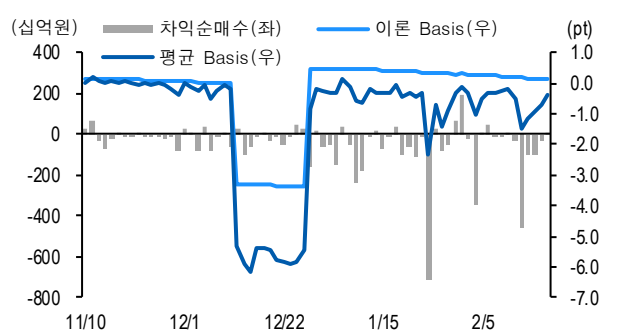


선물옵션시장 지표 2021.2.24

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	415.82	-0.25	-1.06	12,743.3	-
선물 3월물	416.30	-0.14	-0.60	30,029.2	236,540
선물 6월물	415.40	-0.18	-0.75	319.4	30,934
3월물(mini)	416.20	-0.17	-0.80	5,005.9	73,800
4월물(mini)	415.36	-0.08	-0.34	92.7	11,715

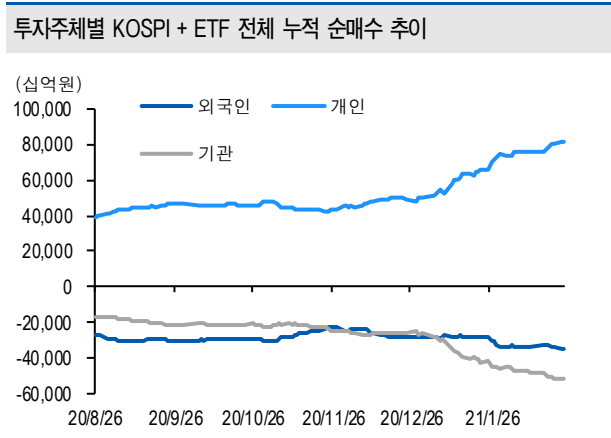


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.13	-0.37	0.48	-0.12%	
베이스스(mini)	0.13	-0.38	0.38	-0.12%	
제1스프레드(SP)	0.16	-0.77	-0.80	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.13	0.44	0.44	0.07%	

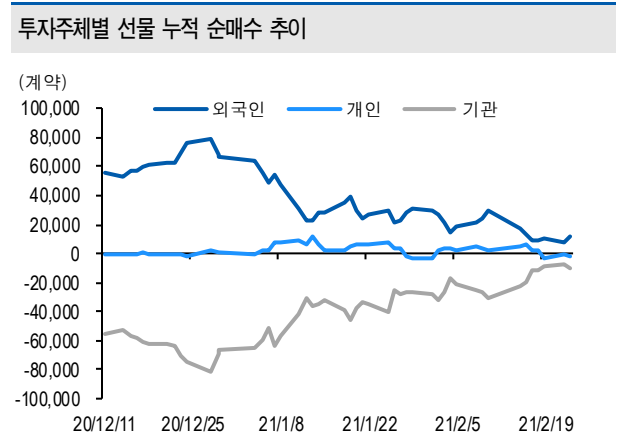


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-374.4	-12.2	-386.6	10.6	-259.5	115.7	264.9	-1.2	5.9	57.8	
개인	77.6	6.4	84.0	0.0	-3.8	-118.9	4.9	0.9	-5.1	-7.7	
기관	301.1	1.4	302.4	2.6	-18.3	-24.7	-271.9	1.0	-3.0	-52.2	
금융투자	344.0	-73.4	270.6	1.4	-0.9	-32.8	-272.1	1.4	-3.3	-28.0	
투신	39.0	-22.6	16.4	-5.2	22.4	14.8	0.0	-0.4	0.0	15.5	
은행+보험+기타금융	-4.5	101.3	96.9	0.0	-22.4	4.2	0.2	0.0	0.3	4.9	
연기금+국가자재	-25.8	-0.2	-25.9	6.4	-6.3	-10.9	0.0	0.0	0.0	-44.5	
기타법인	-4.3	4.5	0.2	0.0	-0.7	27.9	2.1	-0.7	2.2	2.1	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	927,035	370.4	660,267	22.8%	지수옵션 전체	1,718,842	703.3	1,953,292
Put	791,807	332.9	1,293,025	23.7%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	27.16%(-0.48%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	4.44	-0.72	34,738	5,662	1,567	22.6	Put	420.0(K+1)	10.15	-0.15	1,146	7,749	83	22.2
	422.5(K+2)	5.35	-0.76	12,015	3,044	894	22.7		417.5(K+0)	8.88	-0.17	1,603	2,191	18	22.6
	420.0(K+1)	6.43	-0.78	14,944	7,731	615	23.1		415.0(K-1)	7.73	-0.23	1,979	3,216	131	22.9
	417.5(K+0)	7.64	-0.82	8,093	2,731	-487	23.4		412.5(K-2)	6.75	-0.23	3,244	2,051	-21	23.5
	415.0(K-1)	8.99	-0.84	7,878	2,303	820	23.8		410.0(K-3)	5.89	-0.21	5,273	5,953	-249	24.0

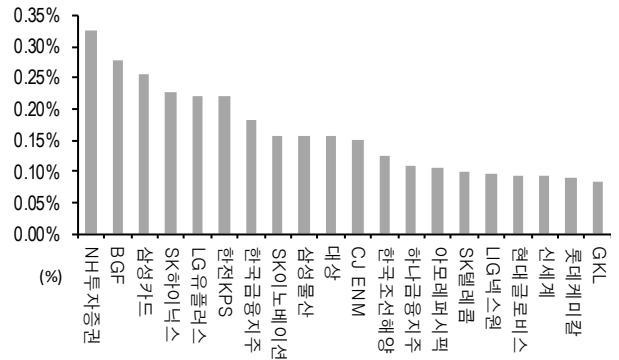
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,019,604	6,493.6	7,467,903	82,937	29,566	16,274	-43,039	57.8	-7.7	-52.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
이마트	178,000	-0.28	53.8	106.9	11,358	-4,400	-0.16%	245	423	-728	4,278	-95
LG 이노텍	219,500	-2.66	67.7	105.8	33,461	-1,100	-0.03%	-1,171	-486	1,655	648	384
NAVER	391,000	1.16	399.4	101.7	80,693	-119	0.05%	-288	527	-229	115	-1,538
SK 이노베이션	285,500	0.53	249.0	100.7	78,225	4,862	0.16%	569	342	-922	-4,370	-1,022
현대모비스	325,500	0.31	180.3	97.9	16,378	-461	0.03%	899	101	-1,000	-941	679
삼성전기	194,000	0.26	101.8	97.8	34,402	0	-0.03%	894	-2,544	1,262	1,232	-423
SK 하이닉스	139,000	1.46	814.3	93.4	494,069	32,539	0.23%	-895	-6,982	8,059	-18,538	483
삼성전자	82,400	0.12	1,560.9	92.9	1,299,743	-40,341	-0.08%	26,163	-15,288	-10,405	5,908	1,516
한국금융지주	93,500	0.00	40.2	87.0	60,359	2,381	0.18%	-1,136	-627	2,062	30	-568
LG 디스플레이	24,550	-1.21	66.9	86.3	607,640	2,079	-0.57%	-4,289	10,408	-5,319	-4,560	2,950

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터