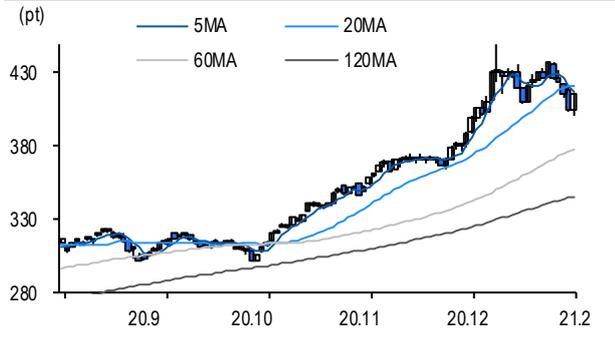
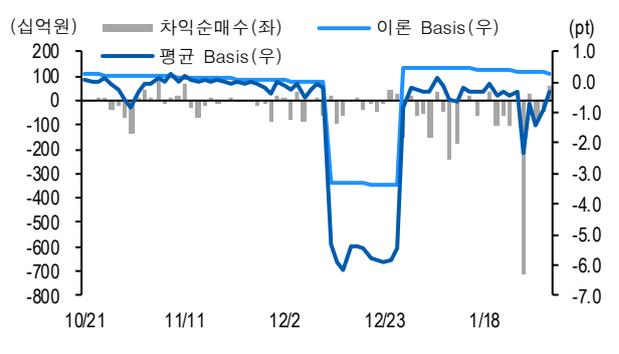


선물옵션시장 지표 2021.2.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	415.45	2.69	10.89	16,330.1	-
선물 3월물	415.30	2.68	10.85	34,382.3	243,495
선물 6월물	414.65	2.73	11.00	24.0	18,644
2월물(mini)	415.28	2.65	10.74	5,181.5	110,572
3월물(mini)	415.00	2.61	10.00	158.8	37,843

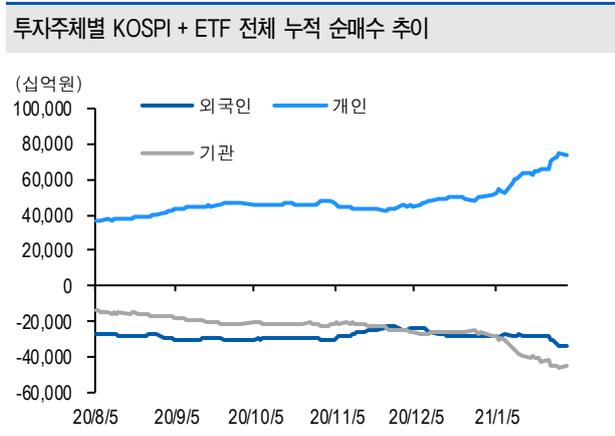


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.30	-0.29	-0.15	-0.14%
베이스(mini)	0.07	-0.20	-0.17	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.53	-0.55	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.07	-0.10	-0.10	-0.04%

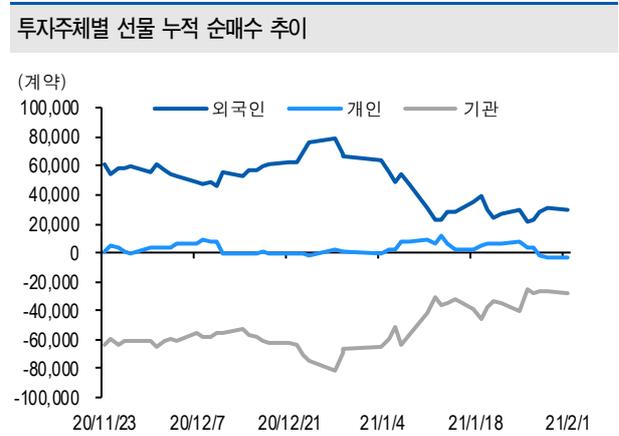


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	131.7	-25.6	106.1	67.2	-268.8	-552.2	354.8	-0.9	1.5	41.9
개인	-781.6	-62.8	-844.5	0.0	1.3	66.8	7.5	1.8	1.3	52.4
기관	688.7	114.0	802.7	-3.1	-122.3	259.1	-372.2	1.3	-3.0	-88.2
금융투자	733.0	-16.2	716.8	0.0	3.7	-541.7	-371.6	1.8	-3.1	-160.4
투신	127.1	68.9	196.0	0.0	57.9	808.2	-0.7	-0.5	0.3	71.8
은행+보험+기타금융	4.5	55.8	60.3	0.0	-15.0	-32.2	0.0	0.0	-0.2	0.2
연기금+국가지자체	-207.8	6.1	-201.7	-3.1	-178.6	24.8	0.1	0.0	0.0	0.1
기타법인	-38.7	-25.6	-64.4	0.0	0.4	226.3	9.9	-2.3	0.2	-6.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,312,691	485.1	713,887	33.3%	지수옵션 전체	2,655,999	943.7	2,269,046
Put	1,343,308	458.6	1,555,159	36.5%	PCR(금액기준)	0.95	VKOSPI	34.16%(-1.57%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	412.5(K+3)	10.65	4.21	4,909	4,136	362	33.1	Put	407.5(K+1)	5.99	-5.66	4,890	4,433	-22	34.9
	410.0(K+2)	12.30	4.77	4,190	4,193	522	34.0		405.0(K+0)	5.25	-5.25	6,814	6,450	9	35.5
	407.5(K+1)	13.95	5.20	2,731	1,770	380	34.6		402.5(K-1)	4.62	-4.84	7,175	4,913	54	36.2
	405.0(K+0)	15.60	5.50	1,960	3,533	165	34.8		400.0(K-2)	4.03	-4.41	14,912	10,954	328	36.9
	402.5(K-1)	17.80	6.55	551	1,032	189	36.9		397.5(K-3)	3.53	-4.07	11,194	5,298	-1,195	37.6

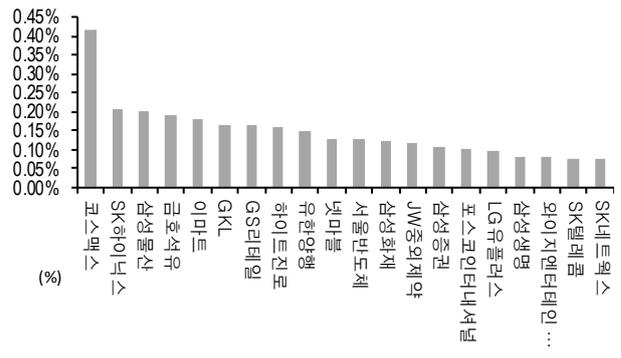
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,023,076	6,808.5	7,675,966	-42,077	84,208	-34,827	-11,944	41.9	52.4	-88.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	238,000	4.62	324.9	78.2	68,747	-1,513	0.05%	227	-6	-221	-2,486	-5,990
기아차	90,000	8.43	506.5	74.6	205,179	10,175	0.04%	-3,824	-2,044	5,080	1,872	-6,184
NAVER	349,000	1.45	247.9	72.3	74,286	-1,105	0.07%	-1,350	-21	1,400	-2,244	3,367
삼성 SDI	749,000	1.90	220.5	68.6	23,624	-74	0.03%	271	-141	-85	-197	593
삼성전기	206,500	1.23	82.6	62.0	27,272	-1,653	0.01%	-1,885	2,772	-923	-258	-304
카카오	441,000	-0.11	244.8	61.8	31,587	-934	0.03%	-301	-782	1,083	74	1,041
엔씨소프트	953,000	0.32	46.5	59.4	3,097	-65	0.04%	115	-91	-24	-2	-11
LG 화학	949,000	3.72	220.6	59.3	16,128	-111	0.07%	158	-443	262	246	76
삼성전자	82,700	0.49	1,355.2	59.1	1,234,719	-30,067	-0.01%	12,588	20,049	-31,637	-37,427	37,211
한국금융지주	84,800	4.43	18.1	57.9	29,006	109	0.01%	1,464	-515	-949	-163	-782

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터