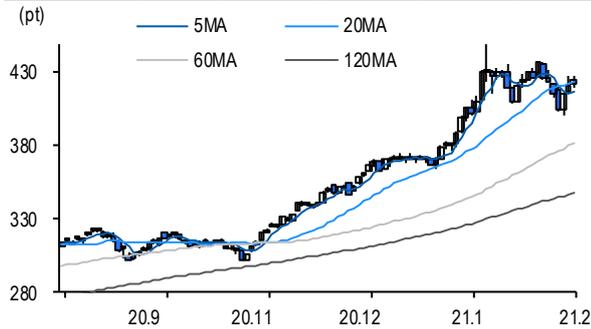


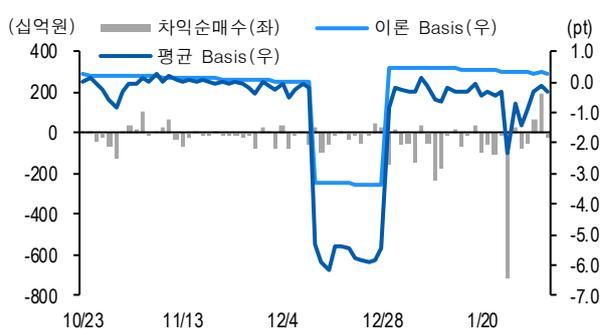
선물옵션시장 지표

2021.2.4

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	425.21	0.99	4.18	17,005.2	-
선물 3월물	425.30	0.76	3.20	32,078.3	231,748
선물 6월물	424.75	0.87	3.65	65.9	19,274
2월물(mini)	425.58	0.80	3.36	4,948.8	116,976
3월물(mini)	425.18	0.73	2.86	186.6	40,874



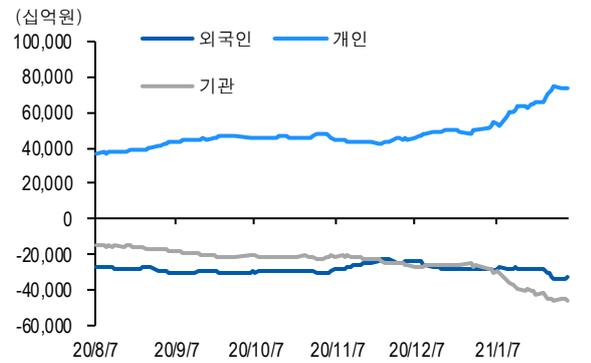
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.31	-0.34	0.09	-0.15%
베이스(mini)	0.06	-0.09	0.37	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.17	-0.46	-0.45	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.06	0.30	0.30	0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	425.8	0.5	426.3	-3.2	180.7	-542.7	-89.0	0.4	6.3	50.4
개인	132.3	7.1	139.4	0.0	55.6	96.5	-19.2	3.5	-2.0	55.1
기관	-581.9	-9.4	-591.3	-16.9	-329.5	442.1	107.4	-2.7	-2.8	-107.6
금융투자	-217.5	42.9	-174.6	-14.9	-13.5	465.7	106.8	-2.4	-2.8	-111.0
투신	18.7	-8.4	10.3	0.0	16.4	-51.8	0.3	-0.3	-0.3	4.7
은행+보험+기타금융	-44.0	-100.0	-144.0	0.0	-38.3	22.0	0.1	0.0	0.3	0.9
연기금+국가자재	-357.6	21.9	-335.7	-2.1	-284.7	6.2	0.0	0.0	0.0	-2.1
기타법인	23.8	1.8	25.6	0.0	7.8	4.1	0.9	-1.1	-1.5	2.0

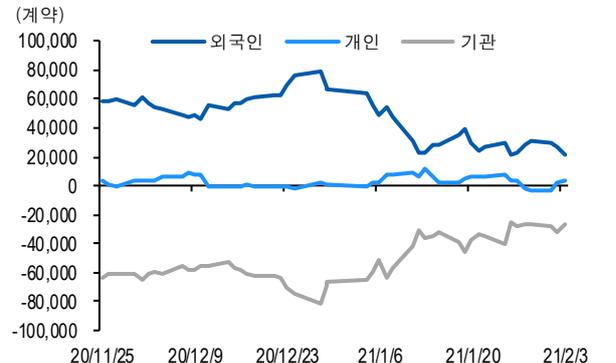
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,433,697	461.6	712,935	28.0%	지수옵션 전체	2,721,165	878.2	2,320,733
Put	1,287,468	416.7	1,607,798	29.1%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	31.29%(-2.11%p)

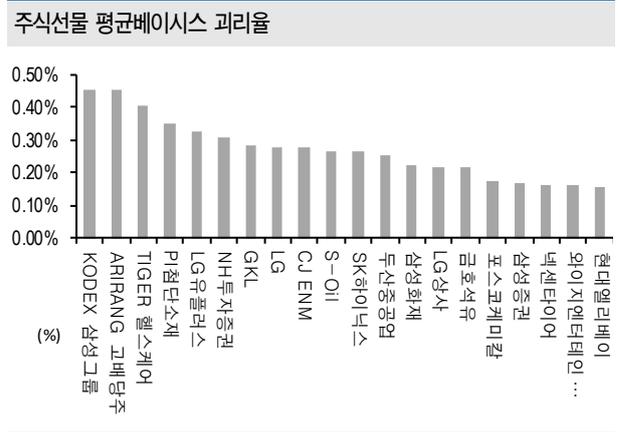
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	5.97	0.39	15,774	5,480	89	27.9	Put	422.5(K+1)	5.54	-2.75	5,945	4,157	-8	27.3
	425.0(K+2)	7.23	0.55	11,335	7,700	993	28.2		420.0(K+0)	4.64	-2.53	11,191	4,881	515	27.9
	422.5(K+1)	8.63	0.69	5,156	4,542	-223	28.6		417.5(K-1)	3.88	-2.31	25,293	4,349	1,358	28.5
	420.0(K+0)	10.15	0.83	5,296	6,324	156	28.9		415.0(K-2)	3.21	-2.14	26,499	4,692	1,021	29.1
	417.5(K-1)	11.90	1.05	1,331	2,432	-224	29.6		412.5(K-3)	2.67	-1.93	30,130	3,782	108	29.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배출 상위 10종목)											(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	6,368,942	7,567.5	7,848,491	12,030	28,016	26,646	-50,282	50.4	55.1	-107.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배출 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	246,500	2.28	685.2	94.8	67,552	-1,027	0.10%	591	4,472	-5,061	-5,740	-302
삼성전기	210,500	0.48	111.5	93.1	37,703	727	0.14%	487	830	-1,311	-12	-922
SK 이노베이션	319,000	0.31	426.8	79.7	59,123	-2,083	0.06%	820	1,997	-2,801	-2,878	2,078
카카오	463,000	3.70	265.1	79.6	32,047	713	0.05%	2,152	515	-2,718	-1,862	-813
NAVER	371,000	2.06	325.7	77.6	67,066	-12,959	0.06%	61	887	-987	-2,487	1,774
하나금융지주	34,900	-0.29	44.4	75.3	108,192	11,495	0.11%	-248	2,081	-1,833	-5,240	-7,852
LG 디스플레이	22,800	2.01	52.1	74.4	626,972	-19,466	-1.11%	-19,017	-4,414	28,841	46,208	-9,990
현대모비스	350,000	4.17	356.6	69.0	22,826	8,318	0.13%	-96	980	-952	-5,744	-1,647
삼성 SDI	760,000	0.93	168.3	68.5	21,559	-442	0.07%	1,213	112	-1,427	-600	-495
한국금융지주	85,700	0.00	15.8	65.7	28,181	432	0.05%	-307	1,083	-776	-1,325	549

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터