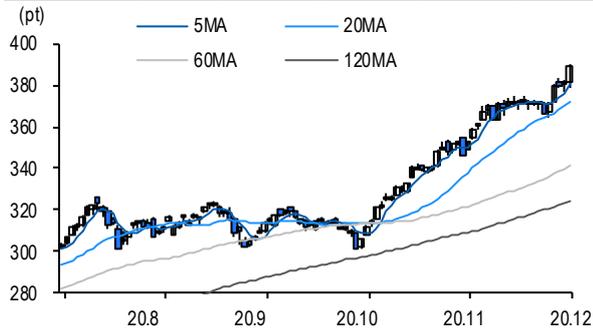
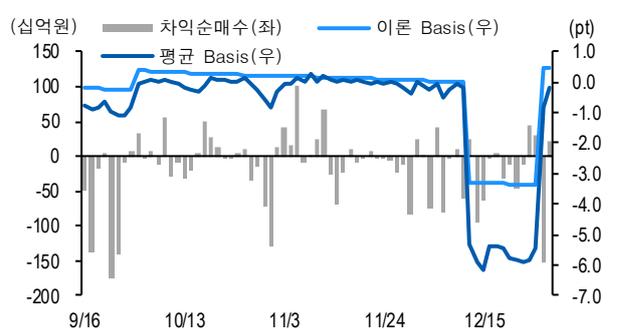


선물옵션시장 지표 2021.1.4

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.29	2.10	8.02	12,816.2	-
선물 12월물	389.15	2.15	8.20	35,048.8	229,859
선물 3월물	388.65	2.14	8.15	86.6	14,064
12월물(mini)	389.16	2.17	8.28	5,001.6	139,975
1월물(mini)	389.70	2.22	8.48	57.3	8,340



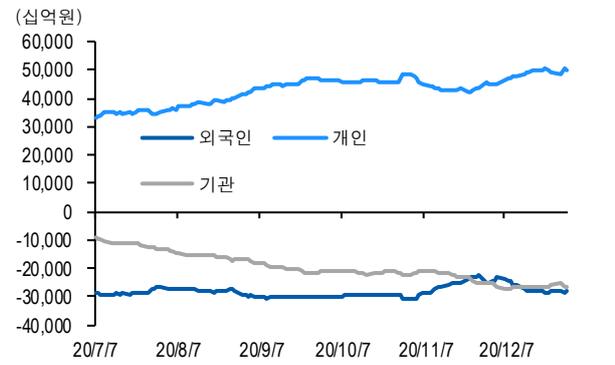
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.50	-0.19	-0.14	-0.18%
베이스스(mini)	0.11	-0.18	-0.13	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.03	-0.42	-0.50	-0.11%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	-0.20	-0.20	-0.08%



	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	245.8	-7.5	238.3	-1.4	173.5	-361.4	496.1	-1.5	1.1	-34.2
개인	-491.6	41.1	-450.5	0.0	-11.5	-13.3	-1.2	0.1	-3.3	-12.4
기관	195.9	-44.0	151.9	24.2	-186.5	277.0	-500.1	0.3	2.6	45.3
금융투자	536.4	159.5	695.9	-3.8	-2.5	-163.2	-500.5	0.9	2.5	20.6
투신	-91.1	-25.9	-117.1	0.0	-57.4	452.0	0.4	-0.6	0.1	31.6
은행+보험+기타금융	-71.6	-265.8	-337.4	-0.8	-47.2	18.5	0.0	0.1	0.0	1.8
연기금+국가자재	-100.3	25.6	-74.7	28.7	-11.6	-30.2	0.0	0.0	0.0	-8.8
기타법인	49.9	10.3	60.2	0.0	-0.5	97.6	5.2	1.0	-0.4	1.3

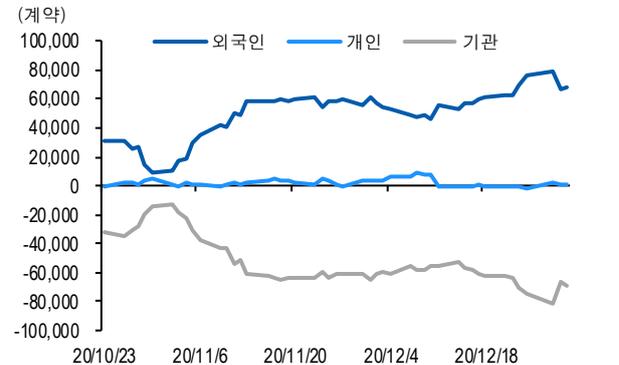
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,846,908	1,035.1	658,759	18.6%	지수옵션 전체	3,280,786	1,459.0	2,096,064
Put	1,433,878	423.9	1,437,305	20.8%	PCR(금액기준)	0.41	VKOSPI	22.09%(+0.46%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	390.0(K+3)	5.72	3.06	127,700	14,224	-1,433	18.5	Put	385.0(K+1)	4.41	-3.94	16,800	5,886	5,031	19.7
	387.5(K+2)	7.04	3.63	52,596	10,470	-2,983	18.6		382.5(K+0)	3.56	-3.34	16,022	5,025	2,865	20.0
	385.0(K+1)	8.49	4.24	32,566	18,171	-3,061	18.7		380.0(K-1)	2.85	-2.81	32,922	6,337	-164	20.2
	382.5(K+0)	10.15	4.86	26,658	10,648	-827	18.9		377.5(K-2)	2.31	-2.30	36,841	7,839	1,586	20.7
	380.0(K-1)	11.95	5.42	12,237	13,270	-817	19.1		375.0(K-3)	1.86	-1.88	56,367	8,721	2,534	21.2

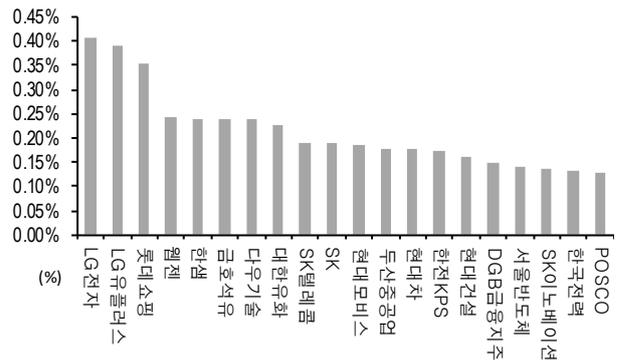
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,590,250	4,950.6	6,859,116	109,646	-16,172	-15,764	30,290	-34.2	-12.4	45.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	80,900	2.80	2,199.5	93.8	1,452,616	57,646	0.10%	-56,443	-34,287	91,343	2,817	9,587
기아차	62,500	-0.32	80.1	73.7	114,977	-30,791	-0.01%	4,469	627	-5,095	3,507	14,398
현대모비스	256,000	1.99	85.1	70.3	15,268	4,752	0.18%	-797	-1,020	1,797	-3,601	-740
삼성전기	179,000	0.85	71.3	64.0	52,543	-1,914	0.08%	-2,982	-913	3,893	1,025	1,777
한화솔루션	48,050	1.05	72.3	63.1	79,345	99	0.01%	-755	215	660	-117	940
LG 화학	828,000	1.97	171.5	62.6	20,646	-659	0.12%	929	1,095	-2,059	-889	-538
SK 하이닉스	119,500	3.02	277.1	56.6	344,444	-13,999	0.12%	-3,038	-12,063	14,768	19,611	-4,900
SK 이노베이션	191,500	4.64	93.2	51.0	73,432	5,735	0.13%	1,938	-1,018	-818	-4,030	-625
호텔신라	82,200	1.11	22.7	49.8	16,311	783	0.03%	293	718	-775	-715	-60
카카오	390,500	1.43	157.6	49.7	37,038	-1,925	0.04%	-2,889	537	2,190	38	3,049

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터