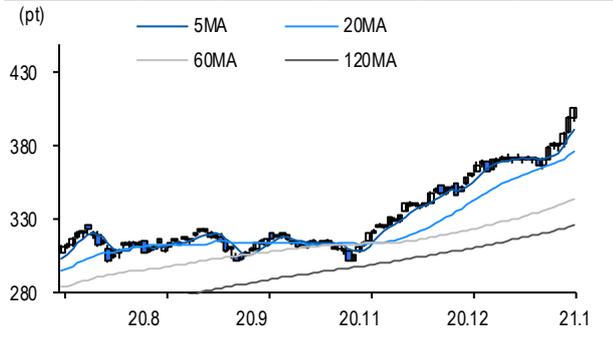


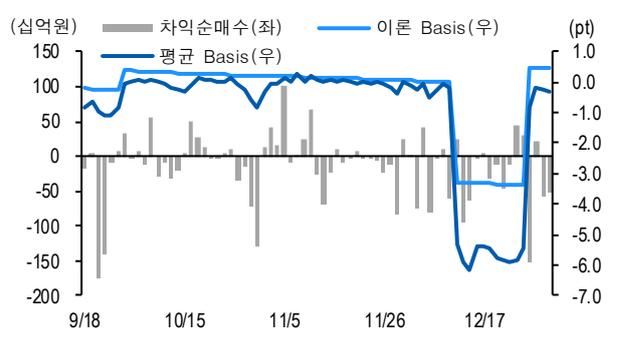


선물옵션시장 지표 2021.1.6

| Market Data |        | (십억원, 계약) |         |          |         |
|-------------|--------|-----------|---------|----------|---------|
|             | 증가(pt) | 등락률(%)    | 등락폭(pt) | 거래대금     | 미결제     |
| KOSPI200    | 406.03 | 1.54      | 6.15    | 20,540.1 | -       |
| 선물 3월물      | 405.55 | 1.24      | 4.95    | 37,405.0 | 232,859 |
| 선물 6월물      | 405.55 | 1.54      | 6.15    | 16.2     | 14,576  |
| 1월물(mini)   | 405.72 | 1.29      | 5.16    | 5,188.8  | 161,297 |
| 2월물(mini)   | 405.60 | 1.26      | 5.04    | 237.5    | 16,664  |

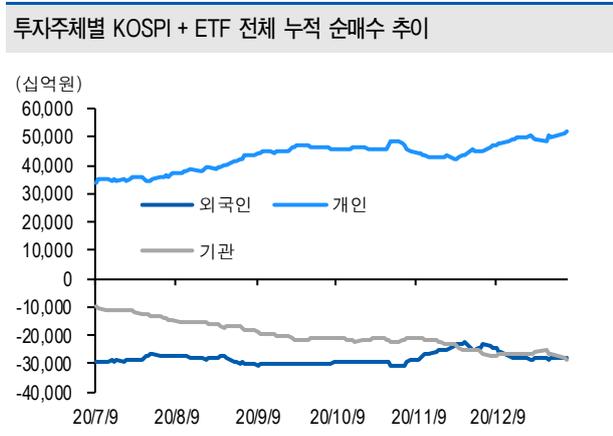


| 차익거래 관련 Market data |      | (pt)  |       |        |  |
|---------------------|------|-------|-------|--------|--|
|                     | 이론값  | 평균값   | 현재가   | 괴리율(%) |  |
| K200 베이스            | 0.48 | -0.30 | -0.48 | -0.19% |  |
| 베이스(mini)           | 0.07 | -0.12 | -0.31 | -0.05% |  |
| 제1스프레드(SP)          | 0.06 | -0.46 | -0.30 | -0.13% |  |
| 합성선물 베이스(ATM)       | 0.07 | -0.30 | -0.30 | -0.09% |  |

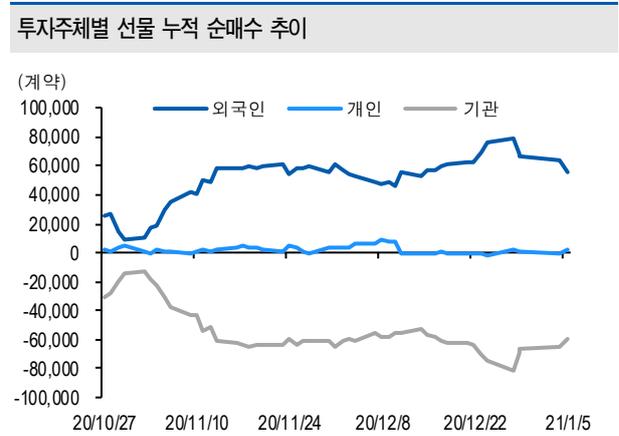


| 투자주체별 매매 동향 |        | (십억원)  |           |       |        |        |             |      |      |        |  |
|-------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|--|
|             | KOSPI  | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F  | K200F(mini) | 콜옵션  | 풋옵션  | 주식선물전체 |  |
| 외국인         | -209.6 | -18.1  | -227.7    | 6.3   | 71.3   | -895.7 | 62.0        | -9.0 | 4.3  | 10.2   |  |
| 개인          | 727.9  | 129.4  | 857.3     | 0.0   | 1.7    | 260.5  | -6.0        | 3.8  | -3.8 | 12.9   |  |
| 기관          | -540.7 | -113.8 | -654.5    | -60.0 | -429.5 | 603.0  | -56.5       | 4.4  | -0.1 | -28.0  |  |
| 금융투자        | 23.2   | -157.2 | -134.0    | -33.9 | -49.1  | 307.7  | -56.2       | 2.2  | 2.4  | -33.7  |  |
| 투신          | -61.6  | 3.7    | -58.0     | 0.0   | -54.9  | 163.2  | -0.4        | -0.7 | -0.1 | 3.4    |  |
| 은행+보험+기타금융  | -97.8  | 24.8   | -73.0     | 0.0   | -96.8  | 1.3    | 0.0         | 2.8  | -2.3 | -0.1   |  |
| 연기금+국가자재    | -340.0 | 8.6    | -331.5    | -26.1 | -201.9 | 130.8  | 0.1         | 0.0  | 0.0  | 2.3    |  |
| 기타법인        | 22.5   | 2.5    | 25.0      | 0.0   | -7.7   | 32.1   | 0.5         | 0.9  | -0.5 | 4.9    |  |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 |           |       |           |       | (계약, 십억원) |           |         |                 |
|-----------|-----------|-------|-----------|-------|-----------|-----------|---------|-----------------|
|           | 거래량       | 거래대금  | 미결제약정     | 대표변동성 |           | 거래량       | 거래대금    | 미결제약정           |
| Call      | 1,594,805 | 711.4 | 709,091   | 24.7% | 지수옵션 전체   | 3,201,532 | 1,229.6 | 2,322,655       |
| Put       | 1,606,727 | 518.2 | 1,613,564 | 27.6% | PCR(금액기준) | 0.73      | VKOSPI  | 26.22%(+1.41%p) |

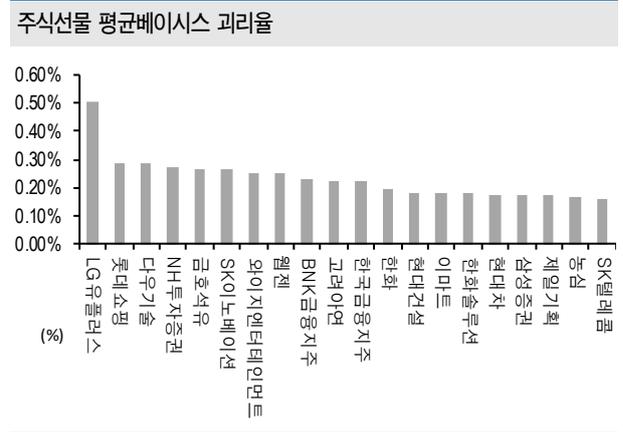
  

|      | 행사가        | 증가    | 등락(pt) | 거래량    | 미결제약정  | 미결제증감  | 내재변동성 |     | 행사가        | 증가   | 등락(pt) | 거래량    | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|-------|--------|--------|--------|--------|-------|-----|------------|------|--------|--------|-------|-------|-------|
| Call | 407.5(K+3) | 5.96  | 2.36   | 48,996 | 9,811  | -1,332 | 24.7  | Put | 402.5(K+1) | 5.31 | -2.77  | 4,582  | 1,631 | 1,408 | 26.1  |
|      | 405.0(K+2) | 7.17  | 2.63   | 54,856 | 10,747 | -2,293 | 24.7  |     | 400.0(K+0) | 4.42 | -1.83  | 14,198 | 5,762 | 3,344 | 26.5  |
|      | 402.5(K+1) | 8.48  | 3.02   | 25,475 | 7,891  | -1,294 | 24.4  |     | 397.5(K-1) | 3.60 | -1.53  | 19,898 | 7,111 | 2,090 | 26.7  |
|      | 400.0(K+0) | 10.15 | 3.47   | 21,600 | 13,290 | -659   | 25.0  |     | 395.0(K-2) | 2.95 | -1.23  | 21,531 | 4,604 | 1,286 | 27.1  |
|      | 397.5(K-1) | 11.80 | 3.70   | 24,076 | 13,757 | 975    | 25.0  |     | 392.5(K-3) | 2.39 | -1.01  | 35,217 | 5,170 | 2,421 | 27.5  |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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) | 금융투자 | 연기금등 |           |  |
| 주식선물 전체                 | 7,505,887 | 7,049.9 | 7,077,393 | 159,611 | 63,016  | 103,023 | -176,626 | 10.2    | 12.9   | -28.0  |      |      |           |  |

| 종목명      | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균괴리율 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
|----------|-----------|---------|--------------|----------|------------|------------|-----------|---------|--------|--------|----------|----------|
| LG 화학    | 900,000   | 1.12    | 327.6        | 99.7     | 20,939     | -984       | 0.16%     | 826     | -211   | -602   | 43       | -253     |
| SK 하이닉스  | 131,000   | 3.15    | 754.6        | 82.1     | 386,822    | 4,060      | 0.11%     | -3,523  | -1,622 | 5,232  | -1,543   | 5,119    |
| SK 이노베이션 | 245,500   | 6.51    | 581.7        | 76.3     | 95,110     | 16,795     | 0.27%     | -1,312  | -3,134 | 4,365  | -9,817   | -4,318   |
| 기아차      | 63,600    | -1.24   | 169.4        | 70.2     | 75,002     | -75,621    | -0.10%    | 1,448   | -1,536 | 52     | 37,156   | 30,146   |
| 삼성전자     | 84,100    | 1.20    | 2,015.9      | 69.6     | 1,313,029  | -15,751    | 0.03%     | 5,590   | -8,218 | 913    | 1,579    | 3,197    |
| 현대차      | 209,500   | 0.24    | 432.7        | 68.6     | 103,230    | -8,349     | 0.18%     | -3,116  | -2,553 | 5,711  | 5,104    | -75      |
| 한국금융지주   | 83,400    | 0.97    | 35.0         | 67.0     | 57,393     | 3,590      | 0.22%     | -390    | 237    | 143    | -3,556   | -1,662   |
| POSCO    | 286,000   | 4.57    | 161.2        | 63.0     | 16,375     | 3,281      | 0.14%     | -359    | 1,934  | -1,580 | -2,778   | -1,431   |
| 현대모비스    | 291,000   | 1.04    | 129.4        | 58.3     | 20,682     | -3,495     | 0.00%     | -1,113  | -2,630 | 3,811  | 3,617    | 1,237    |
| 카카오      | 394,000   | -0.76   | 166.3        | 56.9     | 29,087     | -3,235     | 0.01%     | -475    | -131   | 619    | 1,750    | 1,237    |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

