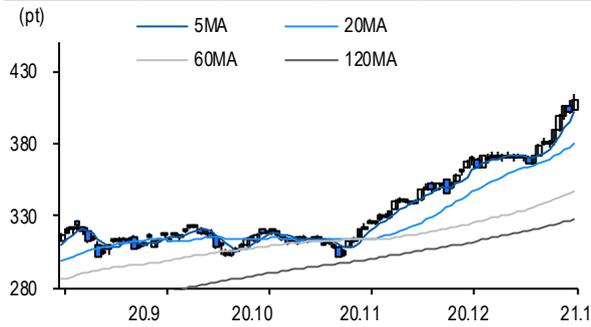
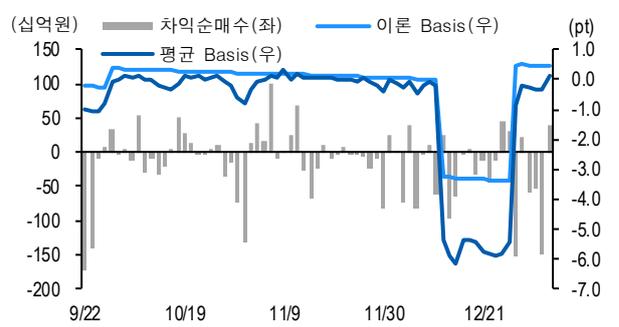


선물옵션시장 지표 2021.1.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	410.81	2.17	8.73	20,615.6	-
선물 3월물	411.80	2.08	8.40	42,970.1	233,830
선물 6월물	411.50	2.16	8.70	31.1	15,081
1월물(mini)	411.84	2.05	8.28	6,473.1	191,797
2월물(mini)	411.90	2.32	9.32	173.6	23,093

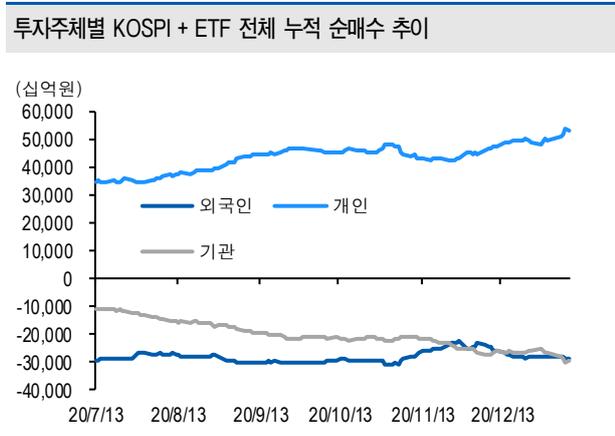


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.47	0.13	0.99	-0.08%
베이스스(mini)	0.05	0.24	1.03	0.05%
제1스프레드(SP)	0.06	-0.42	-0.30	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	0.97	0.97	0.22%

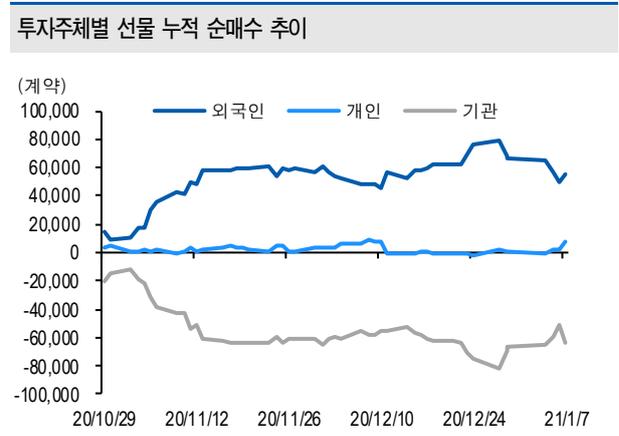


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	109.5	63.5	173.0	14.6	267.5	-368.7	971.3	8.6	2.2	-15.5
개인	-1,172.1	35.8	-1,136.4	0.0	26.5	615.9	16.1	-7.6	-1.6	135.5
기관	1,024.6	-95.6	929.0	23.3	-613.9	-227.0	-996.8	-3.6	0.5	-124.0
금융투자	1,612.4	-122.8	1,489.5	0.0	15.4	-547.6	-1,003.4	-4.0	0.6	-302.1
투신	-18.0	18.3	0.3	0.0	-38.7	509.8	1.2	0.3	-0.1	196.2
은행+보험+기타금융	-101.1	2.7	-98.4	-1.0	-101.8	21.0	5.4	0.1	0.0	-0.6
연기금+국가자재	-441.1	8.1	-433.1	24.4	-480.1	-210.2	0.0	0.0	0.0	-17.5
기타법인	38.0	-3.6	34.5	0.0	3.0	-20.2	9.4	2.6	-1.2	4.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	1,628,135	816.7	763,783	27.3%	지수옵션 전체	3,365,555	1,276.9	2,493,763		
Put	1,737,420	460.1	1,729,980	26.4%	PCR(금액기준)	0.56	VKOSPI	26.75%(-0.85%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	410.0(K+3)	7.03	3.15	44,228	11,166	-4,341	27.2	Put	405.0(K+1)	3.43	-4.03	34,059	5,856	1,936	24.5
	407.5(K+2)	8.54	3.64	16,017	7,976	-685	27.8		402.5(K+0)	2.77	-3.45	43,056	5,366	2,603	25.2
	405.0(K+1)	10.20	4.33	11,722	11,210	-1,216	28.5		400.0(K-1)	2.24	-2.91	87,105	7,524	484	26.0
	402.5(K+0)	12.05	4.77	5,203	7,565	-135	29.5		397.5(K-2)	1.81	-2.50	71,528	9,107	1,113	26.8
	400.0(K-1)	14.05	5.33	3,719	12,372	-29	30.8		395.0(K-3)	1.48	-2.10	94,274	6,558	663	27.7

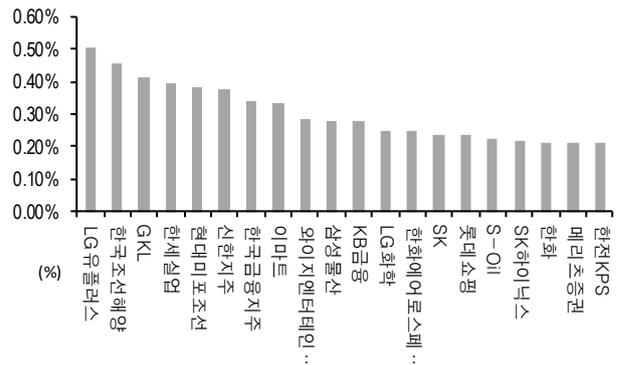
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

주식선물 전체											(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)			
주식선물 전체	7,284,634	7,209.3	7,788,924	464,624	-112,501	158,029	-49,053	-15.5	135.5	-124.0			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	136,000	3.03	593.9	73.6	383,446	20,766	0.22%	1,430	15,921	-17,128	-21,257	-3,202
LG 화학	966,000	8.78	477.8	72.2	25,302	2,966	0.25%	176	409	-846	-2,689	-310
SK 이노베이션	264,500	3.12	370.4	69.9	82,920	-9,698	0.08%	90	-632	572	1,777	7,499
삼성전자	83,300	0.85	1,769.2	65.1	1,404,134	102,617	0.16%	-10,035	42,757	-31,761	-104,379	-8,851
현대모비스	305,000	7.39	272.2	63.5	30,508	8,566	0.15%	658	1,941	-2,710	-3,868	-4,004
현대차	207,500	2.22	326.6	63.5	94,400	2,208	0.17%	-953	9,203	-8,460	-3,681	-4,787
POSCO	293,000	4.46	125.2	56.3	18,607	4,123	0.12%	476	-240	-297	-3,591	-719
삼성 SDI	701,000	4.01	239.4	48.4	16,126	677	0.07%	397	1,498	-1,905	-1,000	-558
카카오	404,000	1.89	148.8	48.1	26,641	-1,849	0.00%	420	-916	605	1,024	136
삼성전기	183,000	3.98	87.3	48.1	44,684	-2,218	0.08%	-467	1,138	-668	182	1,948

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터