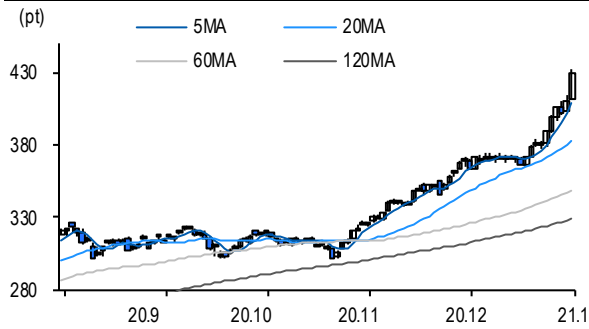


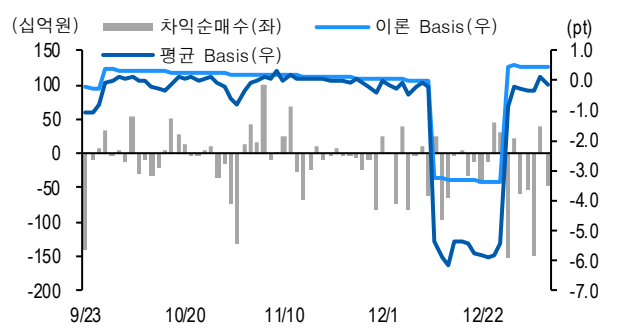


선물옵션시장 지표 2021.1.11

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	430.22	4.72	19.41	34,170.1	-
선물 3월물	430.35	4.50	18.55	55,332.7	238,905
선물 6월물	429.90	4.47	18.40	27.2	16,740
1월물(mini)	430.54	4.54	18.70	8,682.9	202,894
2월물(mini)	430.46	4.51	18.56	286.0	22,286



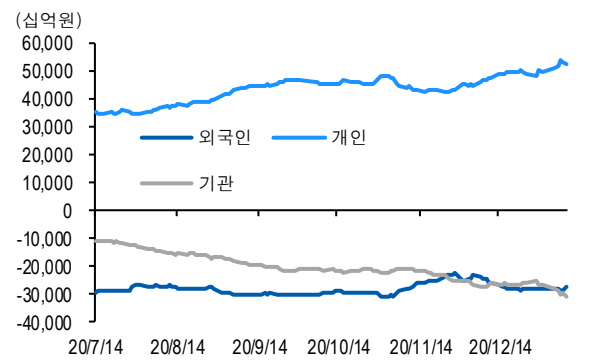
차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.48	-0.13	0.13	-0.14%	
베이스(mini)	0.05	0.13	0.32	0.02%	
제1스프레드(SP)	0.10	-0.21	-0.15	-0.07%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.11	0.11	0.01%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	1,635.4	-33.8	1,601.6	15.9	1,840.3	-641.9	-146.3	9.6	2.7	-10.1	
개인	-557.8	307.8	-250.0	0.0	6.6	39.7	-29.5	-13.4	0.2	172.1	
기관	-1,146.6	-284.0	-1,430.6	-63.9	-517.1	514.9	194.7	-0.7	-0.1	-167.7	
금융투자	-173.2	-195.5	-368.7	-42.4	-48.1	81.4	202.2	-4.2	1.8	-37.4	
투신	-117.5	68.0	-49.6	0.0	-75.9	571.4	-0.2	1.1	-0.2	-253.6	
은행+보험+기타금융	-249.5	-174.5	-424.0	-15.7	-174.0	33.7	-7.4	2.5	-1.7	-2.0	
연기금+국가자재	-609.0	-2.0	-611.0	-5.8	-210.2	-171.7	0.1	0.0	0.0	125.2	
기타법인	69.0	10.0	79.0	0.0	9.2	87.3	-18.9	4.5	-2.8	5.6	

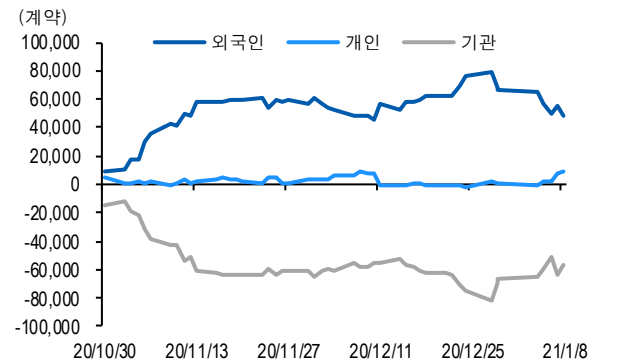
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이





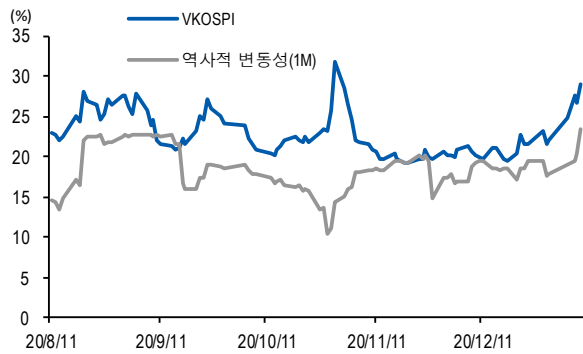
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	2,699,830	1,649.0	762,233	31.3%	지수옵션 전체	5,325,057	2,274.2	2,594,856		
Put	2,625,227	625.2	1,832,623	33.0%	PCR(금액기준)	0.38	VKOSPI	29.18%(+2.43%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	417.5(K+3)	15.40	11.75	29,548	8,772	-3,088	31.2	Put	412.5(K+1)	1.58	-4.81	68,442	5,368	2,767	31.2
	415.0(K+2)	17.55	12.99	17,772	9,208	-1,450	32.5		410.0(K+0)	1.32	-3.90	110,280	7,933	3,354	32.1
	412.5(K+1)	19.65	13.93	8,162	8,286	-599	33.2		407.5(K-1)	1.06	-3.18	99,631	7,949	3,618	32.7
	410.0(K+0)	21.65	14.62	6,307	9,658	-1,508	32.6		405.0(K-2)	0.89	-2.54	142,172	9,009	3,153	33.7
	407.5(K-1)	24.10	15.56	2,566	7,762	-214	35.0		402.5(K-3)	0.75	-2.02	158,855	7,727	2,361	34.7

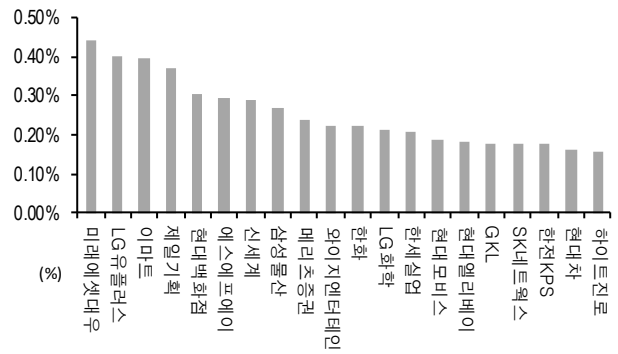
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	10,240,861	12,863.9	7,693,515	-95,409	-38,797	237,189	-209,675	-10.1	172.1	-167.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	88,500	6.24	3,089.0	62.1	1,179,888	-224,246	0.02%	-22,974	32,423	-10,815	28,658	52,018
SK 하이닉스	137,000	0.74	731.2	62.1	294,967	-88,479	-0.12%	2,121	1,843	-3,895	68,824	14,885
SK 이노베이션	283,000	6.99	586.1	61.4	73,427	-9,493	0.02%	1,131	1,214	-2,409	4,597	3,147
LG 화학	999,000	3.42	530.9	60.7	24,096	-1,206	0.21%	-783	-462	1,239	-923	2,034
한국금융지주	90,300	1.35	36.9	54.0	78,585	-12,070	0.13%	-2,118	1,325	788	1,255	10,333
현대차	247,500	19.28	2,456.9	50.8	98,503	4,103	0.16%	6,558	15,428	-22,035	-17,672	-1,448
현대모비스	362,000	18.69	987.4	50.5	49,182	18,674	0.19%	-420	9,562	-9,184	-21,448	947
카카오	434,000	7.43	519.3	49.7	33,424	6,783	0.07%	1,603	2,211	-3,795	-2,410	-3,451
삼성 SDI	742,000	5.85	273.6	45.1	16,778	652	0.05%	-5	720	-726	-601	-317
대한유화	285,000	-2.40	20.3	40.9	11,346	-3,915	-0.12%	-749	829	-81	3,190	857

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터