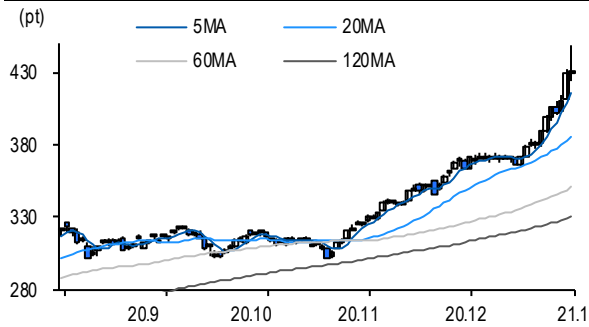
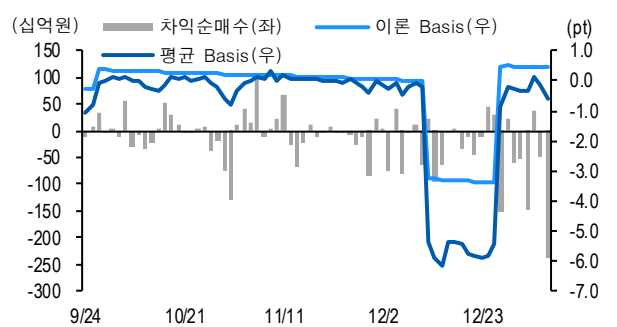


선물옵션시장 지표 2021.1.12

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.13	0.21	0.91	37,081.1	-
선물 3월물	432.55	0.51	2.20	69,292.1	240,221
선물 6월물	430.80	0.21	0.90	43.0	16,785
1월물(mini)	432.94	0.56	2.40	11,955.9	168,055
2월물(mini)	432.50	0.47	2.04	400.2	26,028

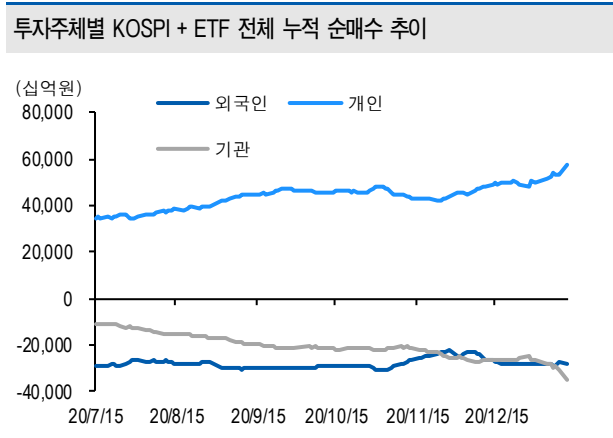


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.46	-0.59	1.42	-0.24%
베이스스(mini)	0.02	-0.07	1.81	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.10	-0.18	-0.25	-0.07%
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	1.87	1.87	0.43%

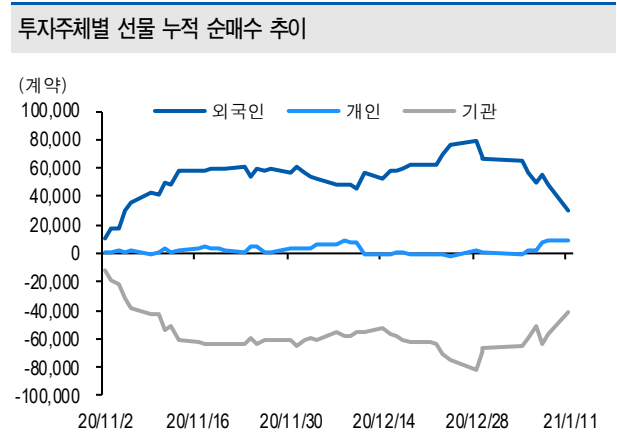


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-714.7	-7.9	-722.6	-3.0	-273.9	-575.7	-1,295.9	42.0	3.5	-49.6
개인	4,485.2	452.5	4,937.7	0.0	-50.9	133.4	11.9	-32.6	-7.1	-125.2
기관	-3,741.2	-439.2	-4,180.4	-237.3	-1,257.5	433.0	1,282.0	-9.4	5.4	172.0
금융투자	-2,021.1	-195.1	-2,216.2	-154.1	-137.8	624.5	1,290.7	-9.8	5.6	352.0
투신	-414.1	-6.9	-420.9	-39.2	-260.9	-316.8	-1.5	0.2	-0.2	-247.7
은행+보험+기타금융	-286.3	-112.9	-399.3	-17.6	-180.8	61.6	-7.2	0.1	0.0	-1.0
연기금+국가자재	-827.8	-102.9	-930.7	-24.2	-540.2	63.7	0.0	0.0	0.0	68.6
기타법인	-29.3	-5.4	-34.7	0.0	-10.7	9.3	2.0	-0.1	-1.7	2.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,071,337	1,537.3	834,685	48.8%	지수옵션 전체	5,985,232	2,813.2	2,780,042
Put	3,913,895	1,275.9	1,945,357	41.7%	PCR(금액기준)	0.83	VKOSPI	35.65%(+6.47%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	6.16	2.26	16,122	7,509	-1,594	49.5	Put	432.5(K+1)	7.96	0.23	38,481	2,370	2,042	40.3
	435.0(K+2)	7.27	2.51	17,077	6,365	-1,180	50.1		430.0(K+0)	6.81	0.39	77,026	5,467	3,352	41.0
	432.5(K+1)	8.47	2.72	12,602	7,004	-3,060	50.6		427.5(K-1)	5.82	0.52	62,788	2,085	175	41.9
	430.0(K+0)	9.81	2.85	10,213	10,279	-2,145	51.3		425.0(K-2)	4.93	0.61	92,166	3,583	1,301	42.6
	427.5(K-1)	11.35	2.98	2,342	8,127	-511	52.5		422.5(K-3)	4.17	0.59	120,055	4,444	1,481	43.4

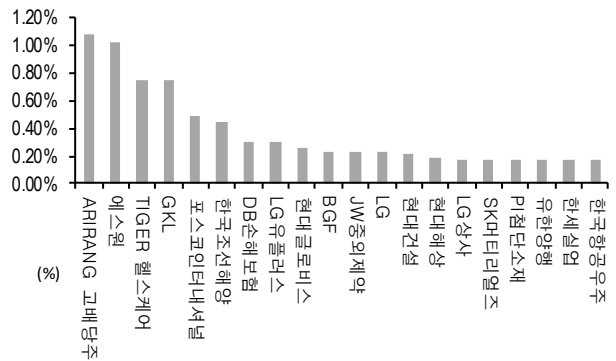
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	13,374,095	15,407.0	7,528,525	-164,990	16,001	-102,508	69,103	-49.6	-125.2	172.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	985,000	-1.10	177.5	82.0	3,232	-549	0.06%	-115	3	110	61	319
한국금융지주	88,700	-1.77	115.1	81.3	50,032	-28,553	0.04%	1,738	-65	-2,154	9,996	7,930
LG 화학	998,000	-0.10	605.8	64.8	19,584	-4,512	0.11%	345	304	-633	902	331
카카오	452,500	4.26	799.4	56.6	22,290	-11,134	0.00%	-937	-4,414	5,686	1,663	4,219
삼성전기	193,500	0.52	198.7	56.2	33,569	-8,954	0.09%	-851	-5,255	6,106	2,664	5,951
삼성전자	91,300	3.16	4,617.4	55.5	934,962	-244,926	0.03%	-59,267	-8,013	67,757	109,711	-13,803
KB 금융	46,000	-1.60	126.3	55.4	83,762	-33,920	-0.02%	8,223	376	-8,953	20,071	6,132
SK 이노베이션	294,500	4.06	676.6	54.6	67,477	-5,950	0.05%	113	2,829	-3,522	2,957	-796
하나금융지주	37,650	-0.13	84.2	53.9	49,557	-58,210	-0.14%	-3,118	-856	3,598	17,466	1,702
롯데케미칼	288,000	-4.64	89.5	53.5	9,350	-550	0.08%	999	495	-1,524	-329	-252

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터