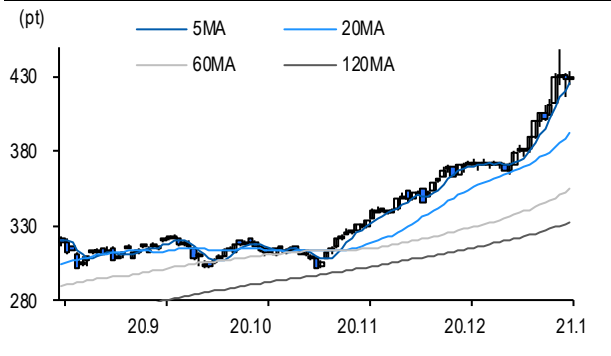


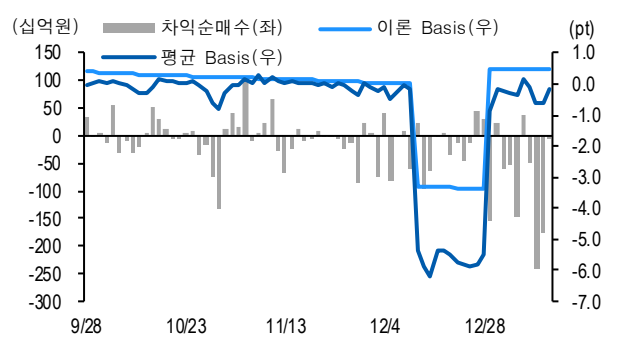


선물옵션시장 지표 2021.1.14

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	430.38	0.59	2.51	18,401.0	-
선물 3월물	428.75	0.25	1.05	45,210.5	228,978
선물 6월물	428.65	0.28	1.20	50.3	17,641
1월물(mini)	429.06	0.21	0.88	6,416.8	139,131
2월물(mini)	428.80	0.24	1.02	602.8	41,404

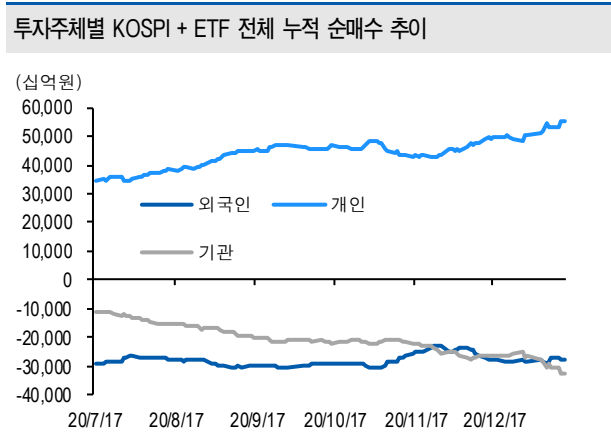


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.45	-0.17	-1.63	-0.14%	
베이스스(mini)	0.01	0.11	-1.32	0.02%	
제1스프레드(SP)	0.10	-0.31	-0.30	-0.10%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-1.27	-1.27	-0.30%	

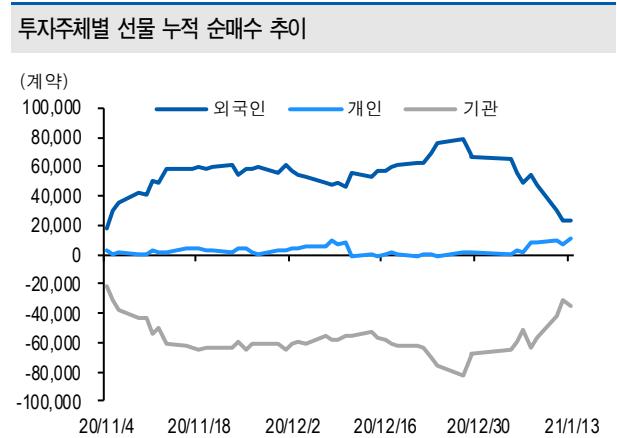


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	195.1	4.1	199.2	1.5	435.5	-75.3	3.8	10.0	6.6	-11.2	
개인	169.0	13.0	182.1	0.0	-0.5	405.0	42.2	-3.5	-4.0	52.6	
기관	-374.3	-9.4	-383.7	-8.5	-563.9	-427.9	-79.5	1.4	-0.9	-50.8	
금융투자	512.9	-110.9	402.0	-4.3	-40.3	-486.5	-90.9	0.1	0.6	-88.2	
투신	-319.8	-13.0	-332.8	0.0	-184.6	83.4	-0.3	1.2	-0.4	64.5	
은행+보험+기타금융	-160.5	136.9	-23.6	0.0	-136.4	-12.9	11.8	0.1	-1.2	-1.4	
연기금+국가자차체	-323.2	-0.4	-323.6	-4.2	-170.7	-11.9	-0.1	0.0	0.0	-25.6	
기타법인	10.1	-7.7	2.4	0.0	-3.2	98.2	33.5	-7.9	-1.7	9.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

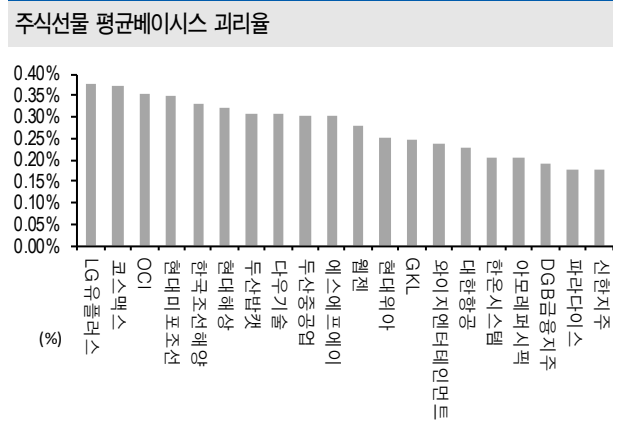
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,855,862	779.3	952,725	26.5%	지수옵션 전체	5,382,668	1,325.7	3,035,409
Put	2,526,806	546.4	2,082,684	33.4%	PCR(금액기준)	0.70	VKOSPI	32.00%(-2.95%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	1.62	-2.34	153,726	11,879	3,235	27.0	Put	430.0(K+1)	4.20	-3.58	23,577	7,339	1,622	34.6
	432.5(K+2)	2.38	-2.45	76,464	6,915	449	26.1		427.5(K+0)	2.95	-3.52	46,842	5,076	1,995	33.5
	430.0(K+1)	3.31	-2.63	55,503	9,402	-4,857	24.5		425.0(K-1)	2.05	-3.23	89,360	6,832	2,549	33.3
	427.5(K+0)	4.56	-2.52	14,141	8,039	-1,714	22.8		422.5(K-2)	1.39	-2.89	104,746	7,487	3,850	33.4
	425.0(K-1)	6.13	-2.26	7,081	8,624	-512	20.5		420.0(K-3)	0.88	-2.58	222,584	10,966	3,677	33.2

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)		
주식선물 전체	8,482,887	8,863.9	7,941,244	390,724	-61,359	58,470	-30,550	-11.2	52.6	-50.8		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	89,700	-1.21	2,196.3	71.2	571,175	-235,888	0.13%	6,700	16,569	-23,569	19,035	-34,602
한국금융지주	86,200	0.47	36.1	66.2	25,370	-5,338	0.06%	458	-622	80	-1,909	-78
SK 이노베이션	280,500	-1.92	304.1	65.9	24,629	-22,888	0.02%	996	-4,380	3,671	7,306	1,337
카카오	455,500	-0.87	224.4	62.9	13,565	-3,716	0.04%	-500	3,035	-2,689	-1,370	-1,665
엔씨소프트	939,000	-1.47	66.2	60.0	1,919	-922	0.08%	6	130	-140	-38	-180
하나금융지주	40,400	3.32	86.5	56.8	44,350	-21,630	0.10%	-2,513	185	2,543	-17,681	964
삼성 SDI	753,000	1.21	235.1	56.4	6,133	-7,396	-0.01%	5	-1,200	1,192	577	638
KB 금융	47,550	2.59	89.7	55.5	100,710	5,326	0.16%	2,355	2,076	-4,452	-2,496	-4,547
SK 하이닉스	133,500	3.49	474.6	54.8	227,520	-4,775	0.08%	-1,494	-3,812	5,299	1,703	523
롯데케미칼	309,000	-2.22	86.4	50.1	9,529	-3,124	0.03%	-2,463	-359	2,822	-193	1,938

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터