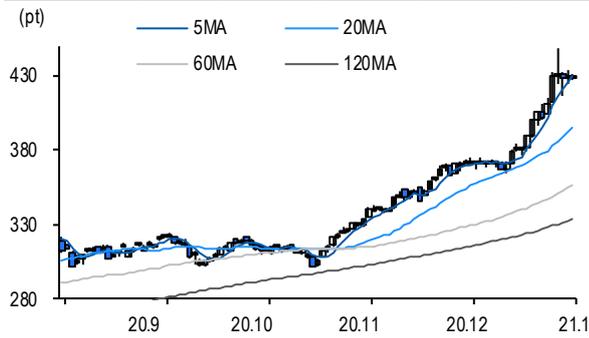


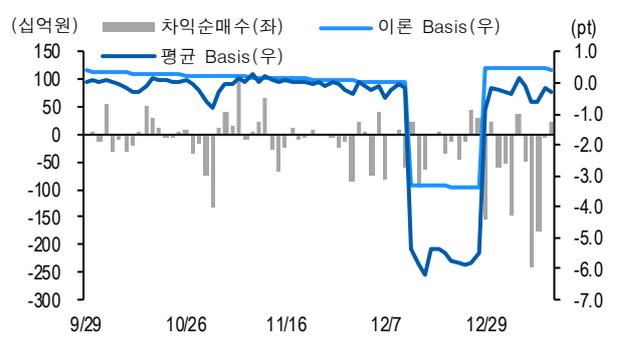


선물옵션시장 지표 2021.1.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	429.85	-0.12	-0.53	18,273.1	-
선물 3월물	430.15	0.33	1.40	32,169.1	220,183
선물 6월물	429.90	0.29	1.25	15.2	17,666
1월물(mini)	428.52	-0.13	-0.54	2,596.4	0
2월물(mini)	430.22	0.33	1.42	1,624.0	64,760

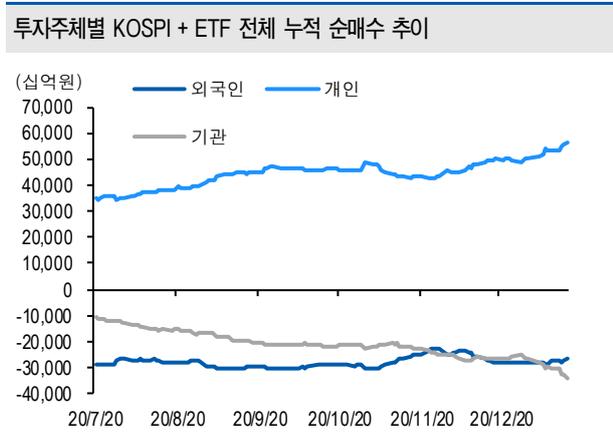


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.44	-0.29	0.30	-0.17%
베이스스(mini)	0.00	0.02	-1.33	0.00%
제1스프레드(SP)	0.10	-0.38	-0.40	-0.11%
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	-1.40	-1.40	-0.33%

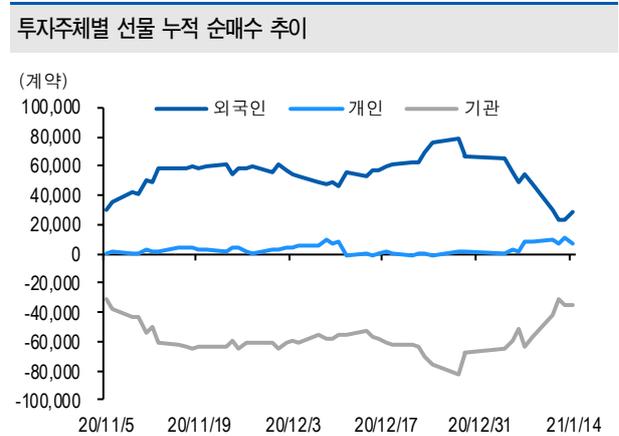


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	677.0	8.6	685.6	107.1	442.1	865.9	-285.7	0.1	6.1	-45.6
개인	713.4	87.0	800.3	0.0	1.1	-497.1	-7.7	-0.4	-2.1	123.4
기관	-1,429.0	-94.5	-1,523.6	-84.9	-828.8	-210.8	305.7	4.5	-2.6	-78.2
금융투자	-484.8	-156.9	-641.7	-20.2	-302.1	-105.8	305.3	-0.8	-0.7	-95.5
투신	-204.8	-42.8	-247.6	0.0	-127.1	-72.9	0.3	-4.7	0.1	94.5
은행+보험+기타금융	-102.2	153.2	50.9	0.0	-74.8	-54.1	0.0	10.3	-2.2	-2.8
연기금+국가자재	-597.8	-43.0	-640.8	-64.8	-330.9	22.0	0.1	-0.3	0.2	-74.3
기타법인	38.6	-1.0	37.6	0.0	0.1	-158.0	-12.4	-4.1	-1.5	0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,292,892	479.6	436,396	9.6%	지수옵션 전체	4,718,837	817.4	1,292,850
Put	2,425,945	337.8	856,454	14.1%	PCR(금액기준)	0.70	VKOSPI	29.68%(-2.32%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	0.01	-1.07	298,403	0	-10,494	14.3	Put	432.5(K+1)	4.03	-1.74	27,557	0	-2,741	27.6
	435.0(K+2)	0.01	-1.61	361,441	0	-11,879	10.1		430.0(K+0)	1.68	-2.52	190,296	0	-7,339	17.9
	432.5(K+1)	0.03	-2.35	371,423	0	-6,915	7.0		427.5(K-1)	0.22	-2.73	334,589	0	-5,076	10.9
	430.0(K+0)	0.13	-3.18	305,602	0	-9,402	2.1		425.0(K-2)	0.02	-2.03	425,477	0	-6,832	10.8
	427.5(K-1)	1.14	-3.42	82,765	0	-8,039	3.7		422.5(K-3)	0.01	-1.38	316,482	0	-7,487	14.1

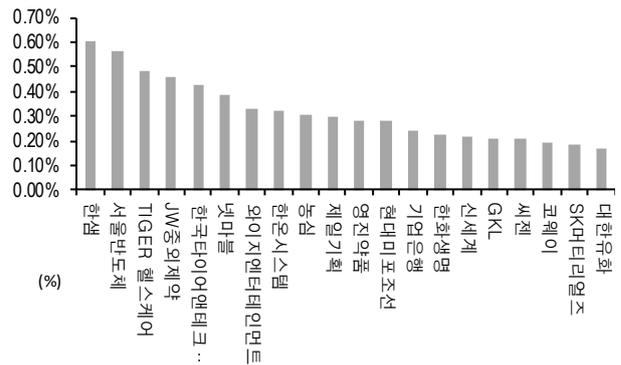
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	7,751,200	7,932.3	6,657,822	-1,283,422	-23,341	66,605	-29,675	-45.6	123.4	-78.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	130,500	-2.25	301.1	44.4	0	-227,520	0.03%	2,733	7,887	-10,557	-2,009	-12,275
이마트	178,500	-1.11	43.2	41.7	0	-21,201	-0.09%	-752	-847	1,599	1,751	1,207
삼성전자	89,000	-0.78	889.8	37.8	0	-571,175	-0.04%	-29,884	22,993	6,574	-22,551	12,519
KB 금융	46,350	-2.52	45.5	35.2	0	-100,710	-0.06%	-495	687	-435	8,096	4,006
씨젠	187,700	2.85	23.5	29.8	0	-22,447	0.21%	247	-337	90	-1,512	-2,224
카카오	453,000	-0.55	97.8	26.8	0	-13,565	-0.01%	-569	-1,107	1,588	820	192
GS 건설	42,650	-0.35	8.3	25.5	0	-28,462	-0.04%	-6,920	88	7,012	-4,864	-2,250
LG 화학	1,005,000	0.70	163.1	24.4	0	-11,993	-0.04%	-155	-235	408	114	-24
현대건설	45,150	1.69	15.4	23.5	0	-44,280	0.01%	3,424	179	-3,605	-3,793	2,174
OCI	106,000	-2.30	7.8	22.7	0	-7,301	-0.46%	187	638	-826	2,789	489

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터