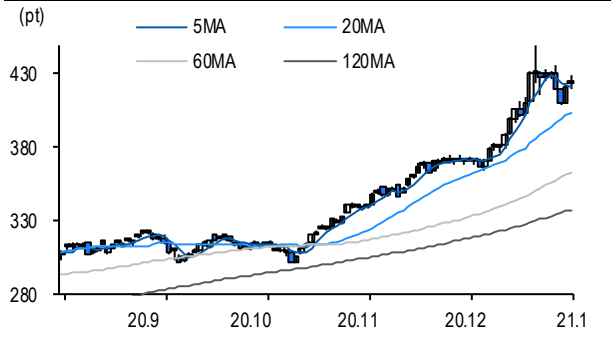


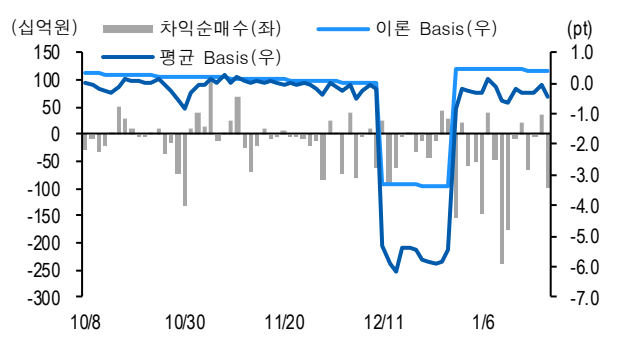


선물옵션시장 지표 2021.1.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	424.01	0.63	2.66	18,597.2	-
선물 3월물	423.60	0.25	1.05	34,222.2	232,417
선물 6월물	423.20	0.37	1.55	29.8	18,518
2월물(mini)	423.90	0.30	1.28	7,057.9	104,572
3월물(mini)	423.16	0.14	0.98	157.2	28,038

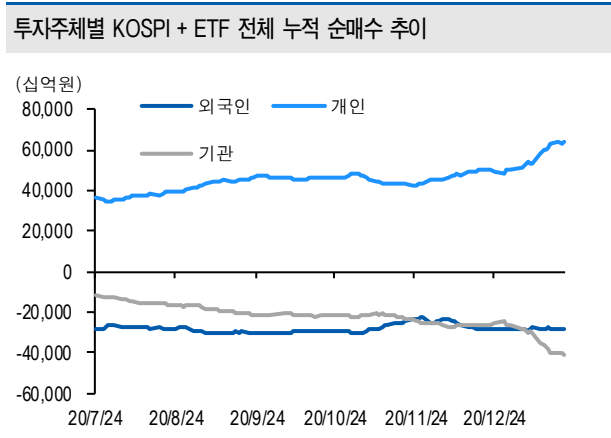


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.40	-0.42	-0.41	-0.19%
베이스스(mini)	0.17	-0.12	-0.11	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.39	-0.35	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.17	-0.06	-0.06	-0.05%

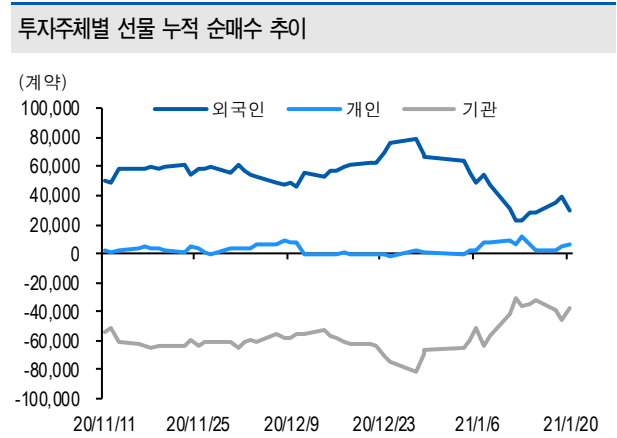


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	-236.9	5.7	-231.2	0.7	-227.7	-515.5	-493.9	1.4	1.3	-3.7
개인	1,437.1	6.0	1,443.1	0.0	-1.4	105.8	-12.2	2.0	-0.6	8.5
기관	-1,234.7	-9.4	-1,244.1	-98.7	-317.0	379.1	505.1	-1.6	-0.1	-8.9
금융투자	-713.5	8.9	-704.6	-71.7	-52.4	548.0	507.8	-1.7	0.0	10.7
투신	-45.3	6.3	-39.1	-19.8	11.7	-196.8	-0.2	0.0	-0.1	-34.1
은행+보험+기타금융	-61.4	-30.4	-91.8	0.0	-45.2	24.7	-2.5	0.0	0.0	1.3
연기금+국가자재	-394.9	-11.4	-406.3	-7.2	-226.6	3.2	0.0	0.0	0.0	13.3
기타법인	34.6	-2.3	32.2	0.0	-1.1	30.6	1.0	-1.8	-0.6	4.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

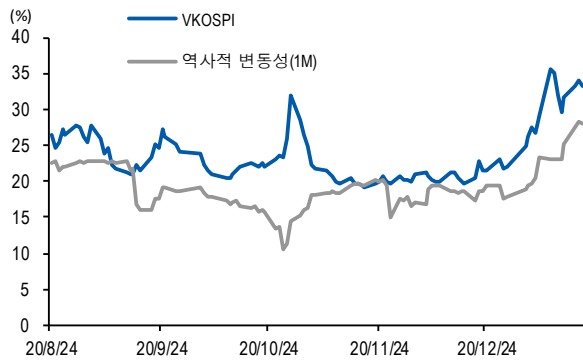
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	572,435	394.9	566,802	30.9%	지수옵션 전체	1,747,783	893.3	1,842,402
Put	1,175,348	498.5	1,275,600	32.3%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	33.32%(-0.76%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	10.20	-0.10	5,667	6,378	209	30.9	Put	425.0(K+1)	13.65	-1.30	1,238	2,230	378	31.9
	427.5(K+2)	11.35	-0.20	1,987	3,204	305	31.0		422.5(K+0)	12.40	-1.45	1,721	4,072	491	31.9
	425.0(K+1)	12.50	-0.05	1,441	5,045	368	31.0		420.0(K-1)	11.30	-1.20	2,525	5,330	1,720	32.2
	422.5(K+0)	13.85	0.05	1,256	3,285	108	31.3		417.5(K-2)	10.20	-1.20	1,987	2,547	19	32.2
	420.0(K-1)	15.15	0.05	1,227	4,457	394	31.3		415.0(K-3)	9.24	-1.16	5,164	2,883	213	32.5

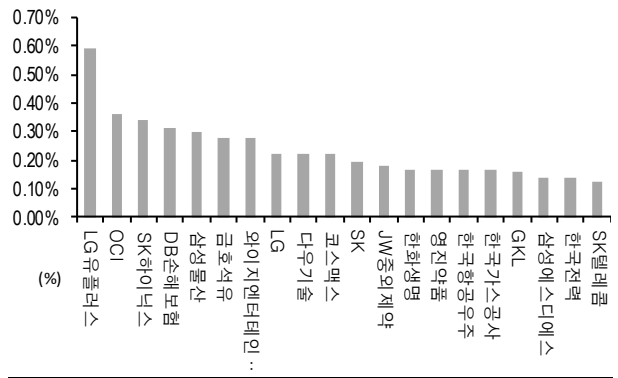
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목) (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	6,211,627	7,467.9	6,971,751	36,663	-25,150	26,067	-8,364	-3.7	8.5	-8.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	273,500	1.11	365.0	88.7	52,919	-80	0.04%	2,726	-840	-1,889	-520	-1,130
LG 화학	1,002,000	0.40	291.6	82.9	16,302	-104	0.01%	649	-319	-328	22	-409
카카오	445,000	0.23	206.4	78.2	26,811	503	0.00%	-1,475	877	600	198	191
SK 하이닉스	131,000	0.38	430.6	66.5	335,685	23,496	0.34%	-1,922	13,184	-11,547	-24,485	1,657
현대차	259,500	-1.33	884.7	63.9	84,474	-4,823	0.04%	-3,142	-3,641	6,665	6,961	4,089
삼성전자	87,200	0.00	1,408.1	63.9	1,254,926	-29,191	0.00%	-15,911	14,734	-343	26,236	18,520
삼성전기	209,000	0.97	110.7	63.6	39,725	-1,126	-0.02%	-2,190	-804	2,989	744	3,627
삼성 SDI	744,000	1.36	194.4	63.0	20,607	553	0.01%	482	-160	-315	225	-533
NAVER	307,500	-0.49	165.9	61.2	40,353	-1,337	0.00%	1,230	-1,559	650	-2,126	3,155
엔씨소프트	967,000	0.94	54.1	60.5	2,449	6	0.01%	23	62	-85	-11	-74

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

