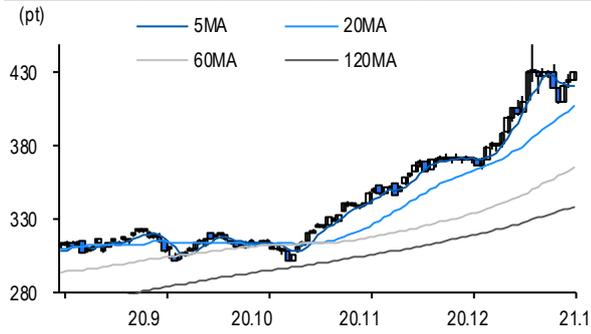


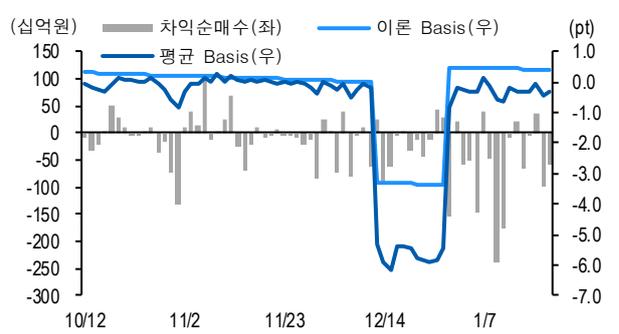


선물옵션시장 지표 2021.1.22

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	430.27	1.48	6.26	18,669.2	-
선물 3월물	429.70	1.44	6.10	30,019.9	229,489
선물 6월물	429.25	1.43	6.05	28.6	18,422
2월물(mini)	430.00	1.44	6.10	5,829.7	108,775
3월물(mini)	429.78	1.46	6.62	66.1	28,438

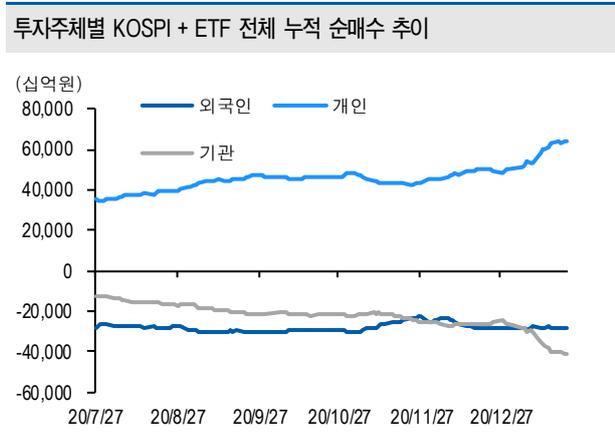


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.40	-0.29	-0.57	-0.16%
베이스스(mini)	0.16	-0.04	-0.27	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.13	-0.41	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.16	-0.31	-0.31	-0.11%

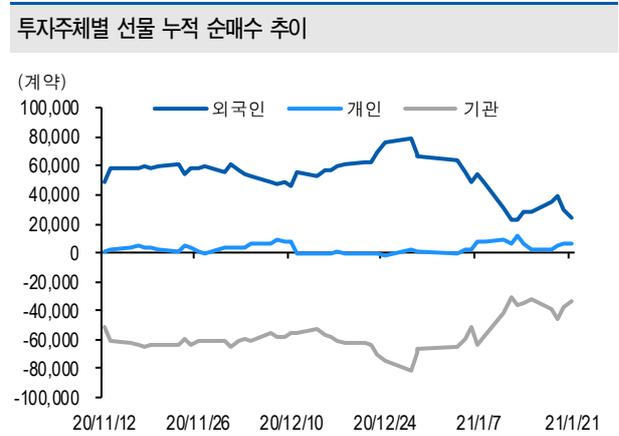


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	230.0	-9.6	220.4	5.8	313.5	-469.5	-20.8	7.9	3.4	-10.5
개인	-82.5	35.9	-46.6	0.0	3.9	102.1	-4.4	-8.1	-2.7	182.8
기관	-133.8	-20.9	-154.7	-65.8	-322.3	356.1	24.2	0.2	-0.9	-176.8
금융투자	243.9	138.9	382.8	-22.9	-13.3	-193.4	21.7	-1.2	0.8	-199.2
투신	-39.6	-7.5	-47.2	0.0	-48.0	493.3	0.0	0.0	0.0	88.8
은행+보험+기타금융	-79.9	-148.8	-228.7	-10.6	-55.7	0.2	2.6	1.5	-1.7	6.0
연기금+국가자재	-270.2	-4.6	-274.8	-32.3	-196.1	56.1	0.0	0.0	0.0	-72.3
기타법인	-13.8	-5.4	-19.2	0.0	-0.1	11.4	1.0	0.0	0.1	4.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	522,523	335.5	568,249	27.7%	지수옵션 전체	1,426,282	617.6	1,883,104
Put	903,759	282.1	1,314,855	29.7%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	30.63%(-2.69%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	432.5(K+3)	10.45	1.20	3,760	4,446	17	27.7	Put	427.5(K+1)	10.55	-4.70	1,655	2,488	318	29.2
	430.0(K+2)	11.70	1.50	2,617	6,634	256	27.9		425.0(K+0)	9.49	-4.16	2,253	2,661	431	29.4
	427.5(K+1)	13.00	1.65	1,602	3,388	184	28.0		422.5(K-1)	8.44	-3.96	2,301	4,025	-47	29.4
	425.0(K+0)	14.45	1.95	1,092	4,959	-86	28.2		420.0(K-2)	7.60	-3.70	6,600	5,443	113	29.8
	422.5(K-1)	15.60	1.75	423	3,228	-57	27.4		417.5(K-3)	6.75	-3.45	4,588	2,841	294	29.9

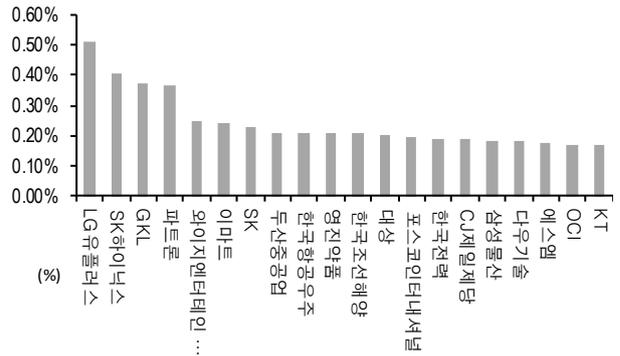
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,425,898	6,798.6	7,454,521	482,770	-61,265	262,247	-211,879	-10.5	182.8	-176.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	277,000	1.28	251.5	93.2	52,411	-508	0.09%	190	-200	-31	-286	310
카카오	455,000	2.25	209.4	67.9	30,666	3,855	0.03%	8	3,009	-3,052	-1,774	-2,380
한국금융지주	87,800	-0.90	17.3	65.7	52,169	-17	0.12%	-1,138	1,074	54	-15	730
현대모비스	363,000	6.14	309.6	65.1	34,949	16,738	0.14%	1,922	6,222	-8,163	-8,994	-7,064
삼성 SDI	745,000	0.13	174.8	62.4	20,501	-106	0.01%	-702	442	252	359	462
현대차	266,000	2.50	411.3	60.5	88,329	3,855	0.05%	2,797	3,514	-6,235	-3,729	-2,772
삼성전자	88,500	1.49	1,257.2	58.9	1,413,667	158,741	0.02%	-6,689	88,193	-83,150	-98,183	-19,776
SK 하이닉스	132,000	0.76	229.5	58.2	344,150	8,465	0.41%	3,457	-4,865	1,519	-10,665	-1,346
LG 화학	992,000	-1.00	202.3	55.8	16,614	312	0.06%	-86	715	-629	-428	-482
NAVER	323,000	5.04	325.5	52.3	46,079	5,726	-0.03%	-1,043	3,249	-2,508	-5,236	167

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터