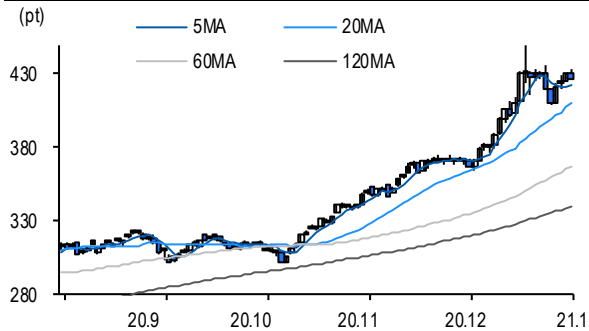


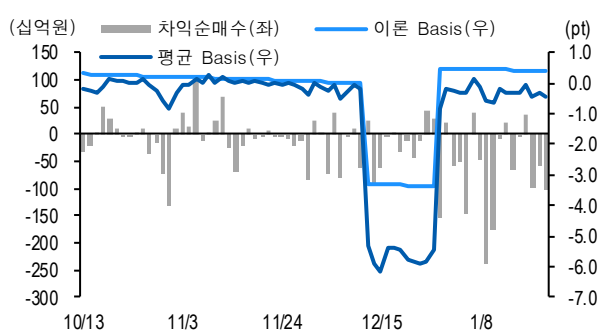
선물옵션시장 지표

2021.1.25

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	427.13	-0.73	-3.14	18,829.3	-
선물 3월물	426.75	-0.69	-2.95	34,906.8	230,931
선물 6월물	426.20	-0.71	-3.05	40.3	18,442
2월물(mini)	427.00	-0.70	-3.00	7,045.7	100,461
3월물(mini)	426.46	-0.75	-3.32	80.3	28,889



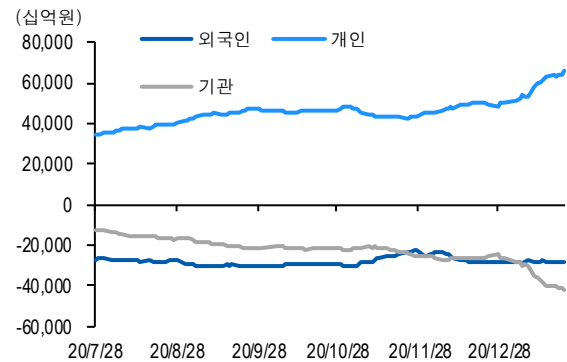
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.39	-0.47	-0.38	-0.20%
베이스스(mini)	0.15	-0.13	-0.13	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.41	-0.40	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	-0.05	-0.05	-0.05%



	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-270.4	-1.4	-271.8	0.5	-213.9	548.3	-351.6	0.7	-1.0	-65.1
개인	1,611.1	110.0	1,721.1	0.0	-6.9	-54.3	-11.0	-1.0	0.1	42.2
기관	-1,365.4	-111.4	-1,476.9	-105.3	-396.3	-507.2	357.6	-0.1	1.7	18.9
금융투자	-667.2	39.9	-627.4	-96.6	-52.8	-3.0	360.5	-0.2	1.7	27.6
투신	-136.3	-23.9	-160.2	0.0	-63.5	-567.3	0.0	0.0	-0.2	-79.7
은행+보험+기타금융	-86.8	-100.5	-187.3	-10.8	-68.3	70.2	-2.9	0.1	0.2	2.0
연기금+국가자재	-375.3	-8.8	-384.1	2.1	-137.9	-7.2	0.0	0.0	0.0	69.0
기타법인	24.7	2.8	27.5	0.0	-3.5	13.3	4.9	0.4	-0.8	4.1

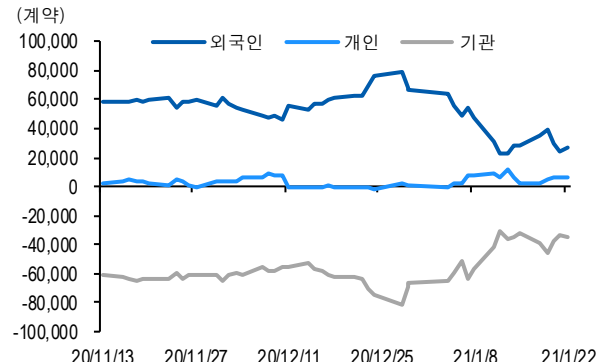
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	627,605	341.6	573,874	26.3%	지수옵션 전체	1,728,392	721.9	1,957,506		
Put	1,100,787	380.3	1,383,632	27.4%	PCR(금액기준)	1.11	VKOSPI	29.36%(-1.27%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	6.26	-2.12	3,012	2,214	-74	26.2	Put	432.5(K+1)	13.85	0.85	926	1,415	294	27.5
	435.0(K+2)	7.14	-2.24	2,778	3,597	98	26.2		430.0(K+0)	12.20	0.45	2,570	3,060	599	27.0
	432.5(K+1)	8.17	-2.28	1,537	4,474	28	26.3		427.5(K-1)	10.95	0.40	2,380	2,797	309	27.2
	430.0(K+0)	9.28	-2.42	2,621	7,028	394	26.4		425.0(K-2)	9.76	0.27	6,190	3,072	411	27.3
	427.5(K-1)	10.55	-2.45	774	3,299	-89	26.7		422.5(K-3)	8.68	0.24	4,416	4,231	206	27.5

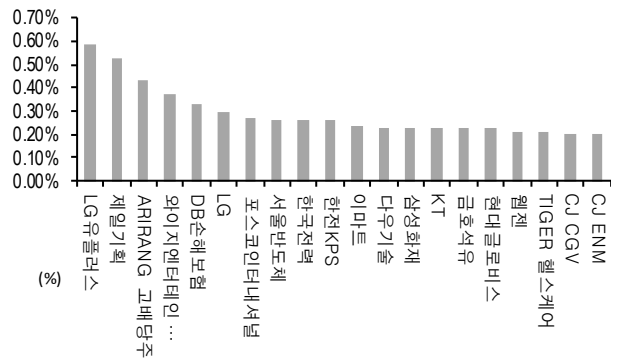
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,482,436	6,557.8	7,400,922	-53,599	-58,270	26,473	27,500	-65.1	42.2	18.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	279,500	0.90	386.4	90.2	50,677	-1,734	0.05%	-803	3,937	-3,203	84	448
한국금융지주	87,000	-0.91	31.3	87.9	57,570	5,401	0.15%	1,760	858	-2,618	-2,399	-2,636
삼성전기	213,000	0.71	169.8	73.8	33,086	-5,981	0.07%	187	1,977	-2,185	-1,456	2,279
현대차	257,000	-3.38	336.0	62.4	88,452	123	0.00%	-2,826	83	2,745	1,090	5,229
LG 화학	978,000	-1.41	228.3	60.2	16,104	-510	0.05%	223	751	-1,013	37	226
카카오	464,000	1.98	325.5	60.1	32,183	1,517	0.04%	250	426	-714	-2,593	1,410
NAVER	344,000	6.50	645.8	58.0	57,311	11,232	0.06%	352	3,478	-3,770	-5,784	-1,824
SK 하이닉스	129,000	-2.27	290.2	56.9	331,605	-12,545	0.16%	-8,894	1,338	7,555	11,849	5,102
현대모비스	352,000	-3.03	139.6	51.4	32,371	-2,578	0.13%	-2,189	607	1,564	-784	3,380
기아차	87,900	-4.14	320.6	51.2	132,689	-27,622	-0.01%	-2,011	-10,234	12,483	15,805	11,816

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터