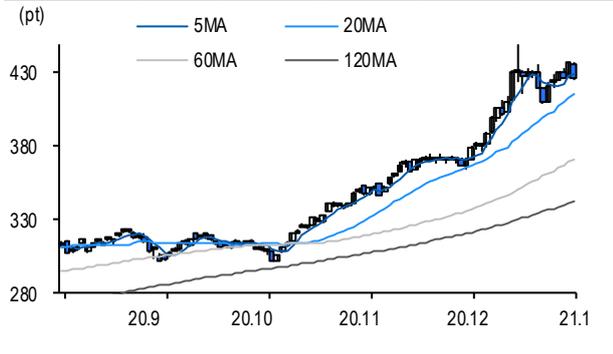


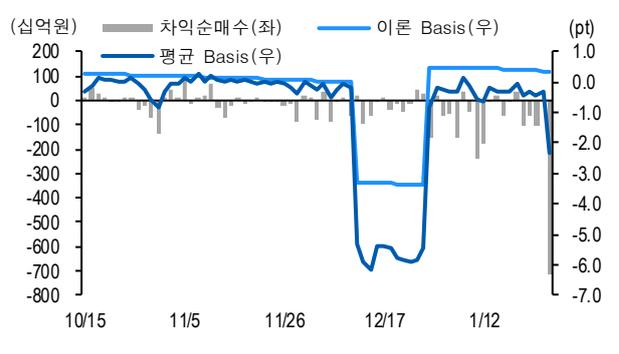


선물옵션시장 지표 2021.1.27

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	426.73	-2.42	-10.57	17,437.8	-
선물 3월물	424.90	-2.68	-11.70	39,451.7	233,709
선물 6월물	424.45	-2.66	-11.60	56.2	19,285
2월물(mini)	425.14	-2.70	-11.80	6,500.6	100,168
3월물(mini)	424.74	-2.72	-12.36	118.3	33,772

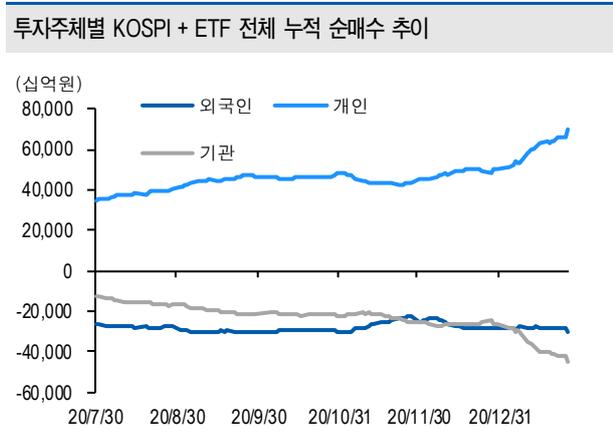


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.35	-2.32	-1.83	-0.63%	
베이스스(mini)	0.12	-2.02	-1.59	-0.50%	
제1스프레드(SP)	0.13	-0.49	-0.50	-0.15%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	-1.67	-1.67	-0.42%	

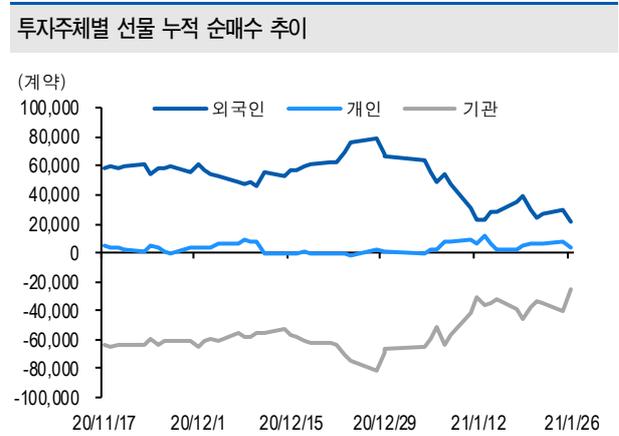


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-1,974.1	1.3	-1,972.9	-330.7	-1,179.9	-350.0	-608.7	124.3	1.7	-247.7	
개인	4,220.5	198.1	4,418.5	0.0	2.2	-534.6	39.6	-124.3	0.8	-37.3	
기관	-2,250.3	-201.2	-2,451.5	-383.9	-791.9	1,030.3	570.3	3.2	-2.2	285.5	
금융투자	-778.6	-409.2	-1,187.7	-8.7	-112.5	614.9	571.4	3.8	-2.3	201.6	
투신	-295.3	-0.1	-295.3	-87.3	-143.6	-190.5	-0.9	-0.6	0.0	-114.9	
은행+보험+기타금융	-320.0	187.9	-132.1	-60.8	-228.4	273.5	-0.1	-0.1	0.1	2.7	
연기금+국가자자체	-643.3	9.3	-634.1	-177.4	-195.0	332.4	-0.1	0.0	0.0	196.0	
기타법인	4.0	1.8	5.8	0.0	0.5	-145.6	-1.2	-3.2	-0.3	-0.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,269,246	634.6	617,173	25.3%	지수옵션 전체	2,712,827	1,246.3	2,094,465
Put	1,443,581	611.7	1,477,292	29.8%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	29.99%(+1.02%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	445.0(K+3)	2.89	-3.81	43,330	9,879	1,453	25.5	Put	440.0(K+1)	19.10	7.00	235	1,121	-50	31.3
	442.5(K+2)	3.47	-4.19	25,124	4,448	371	25.5		437.5(K+0)	17.20	6.70	423	806	74	30.7
	440.0(K+1)	4.04	-4.69	35,404	8,667	1,648	25.3		435.0(K-1)	15.40	6.11	1,161	1,972	54	30.2
	437.5(K+0)	4.76	-5.14	10,581	3,688	1,000	25.2		432.5(K-2)	13.75	5.56	1,556	2,071	189	29.8
	435.0(K-1)	5.45	-5.75	9,877	4,963	1,364	24.8		430.0(K-3)	12.25	5.06	3,785	3,999	-31	29.7

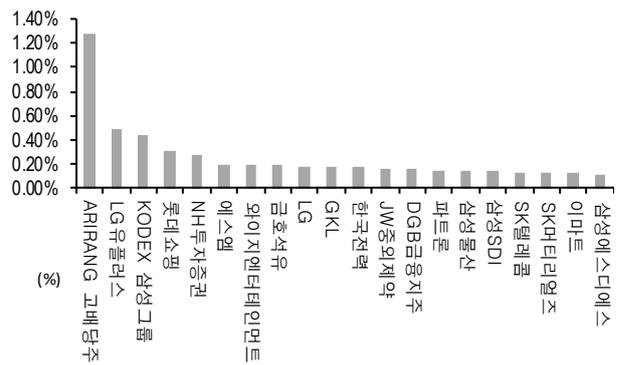
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	6,029,573	6,741.7	7,858,253	74,026	-261,954	12,940	228,357	-247.7	-37.3	285.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	288,000	0.00	424.0	91.4	53,678	-402	0.09%	-154	-3,211	3,331	1,043	-716
삼성전기	216,500	0.93	174.7	85.7	34,444	1,556	0.00%	-676	-6,479	7,182	3,973	2,006
삼성 SDI	791,000	-0.38	315.8	84.5	25,839	2,461	0.14%	-849	1,832	-901	-1,329	512
현대차	251,000	-3.83	332.9	71.4	81,056	-4,384	-0.07%	-5,505	-3,884	9,493	8,855	6,934
카카오	462,000	-2.63	229.7	61.1	33,701	-212	0.02%	-1,957	425	1,530	1,378	222
SK 하이닉스	129,000	-4.80	471.5	58.2	325,875	-15,859	0.01%	-12,101	-4,847	17,108	22,973	9,705
기아차	90,000	-4.15	294.6	56.7	193,162	22,537	0.10%	-2,489	3,744	-1,460	-11,999	-7,417
삼성전자	86,500	-3.46	1,618.8	56.5	1,283,046	-42,738	-0.01%	-120,338	-22,236	145,095	71,574	90,737
NAVER	342,000	-2.01	241.3	56.5	60,797	10	0.02%	-2,569	1,215	1,343	772	459
한국금융지주	87,100	-1.47	21.1	55.9	52,769	-4,819	0.03%	-2,514	-1,204	3,718	2,695	4,765

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터