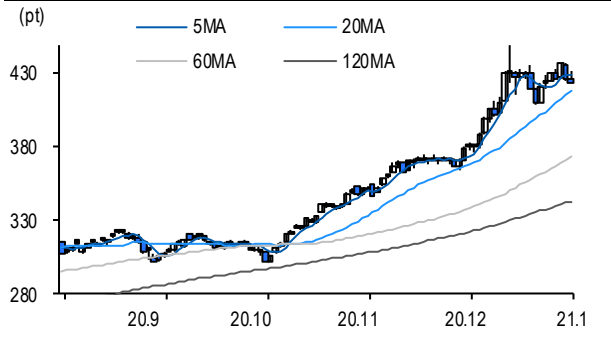


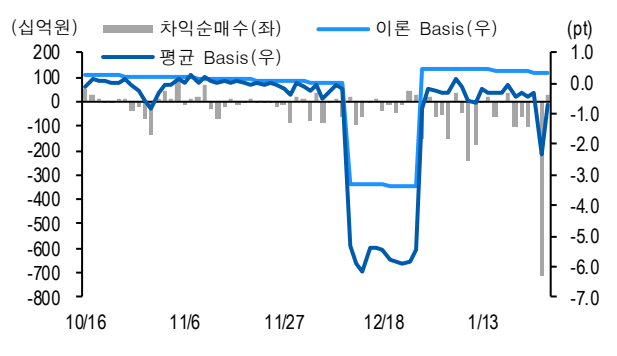


선물옵션시장 지표 2021.1.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	423.67	-0.72	-3.06	15,254.4	-
선물 3월물	422.95	-0.46	-1.95	38,790.7	237,951
선물 6월물	422.45	-0.47	-2.00	37.4	18,984
2월물(mini)	423.20	-0.46	-1.94	6,153.3	100,213
3월물(mini)	423.24	-0.39	-1.50	140.7	34,245

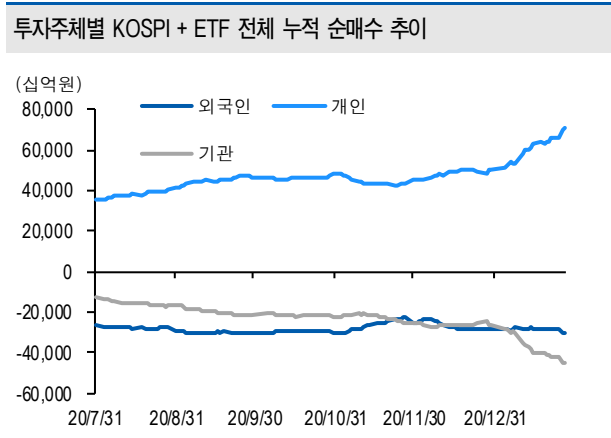


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.35	-0.69	-0.72	-0.25%
베이스스(mini)	0.11	-0.54	-0.47	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.12	-0.51	-0.50	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	-0.30	-0.30	-0.10%

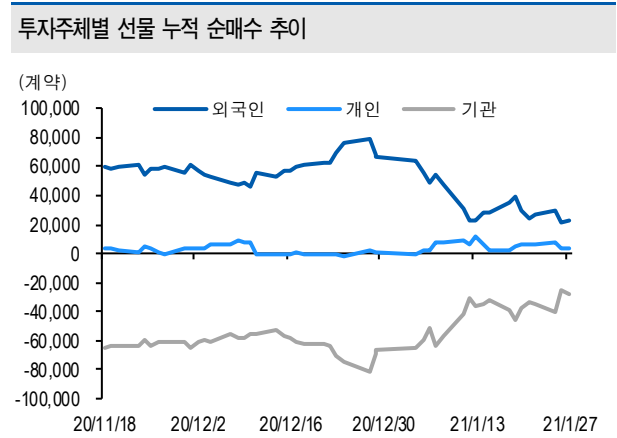


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-622.6	-15.8	-638.4	9.1	-289.1	264.3	-68.4	1.3	0.5	81.0
개인	1,065.8	85.0	1,150.8	0.0	5.4	19.2	-18.9	0.0	0.4	-133.4
기관	-395.9	-66.1	-462.0	15.3	-292.4	-333.6	81.9	1.4	0.0	59.3
금융투자	122.6	-241.6	-119.1	0.0	-3.6	-101.1	81.8	0.6	0.0	90.3
투신	-153.0	5.6	-147.4	0.0	-115.9	-219.1	0.1	0.7	0.0	-4.3
은행+보험+기타금융	-45.2	160.4	115.2	0.0	-16.6	-9.4	0.0	0.1	0.0	7.1
연기금+국가지자체	-261.6	-0.1	-261.6	13.1	-140.4	-4.1	0.0	0.0	0.0	-33.8
기타법인	-47.3	-3.1	-50.4	0.0	-0.3	50.2	5.4	-2.7	-0.9	-6.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





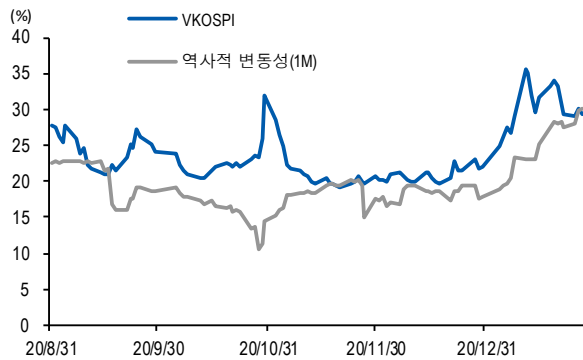
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,246,719	498.7	642,524	25.3%	지수옵션 전체	2,476,378	994.9	2,154,687
Put	1,229,659	496.3	1,512,163	27.2%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	29.41%(-0.58%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	435.0(K+3)	4.32	-1.13	16,402	5,216	253	25.4	Put	430.0(K+1)	12.50	0.25	1,877	4,359	360	26.3
	432.5(K+2)	5.08	-1.37	8,250	5,353	843	25.3		427.5(K+0)	11.10	0.25	2,612	3,287	-244	26.5
	430.0(K+1)	5.96	-0.98	10,990	7,596	653	25.3		425.0(K-1)	9.94	0.38	4,406	3,974	386	27.2
	427.5(K+0)	6.97	-1.31	2,798	3,538	-65	25.3		422.5(K-2)	8.68	0.19	5,216	4,988	160	27.2
	425.0(K-1)	8.09	5.88	1,937	5,427	223	25.3		420.0(K-3)	7.58	0.12	11,535	5,490	914	27.4

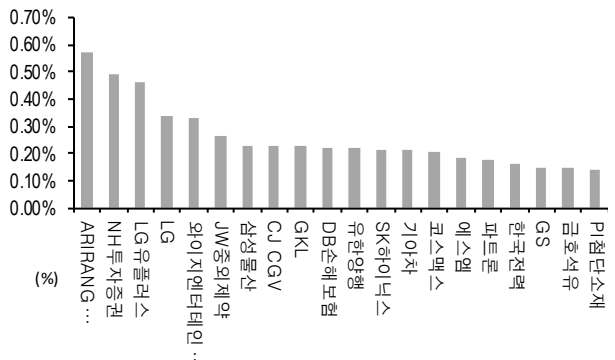
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,563,800	7,735.0	7,880,612	22,359	53,307	-67,503	19,186	81.0	-133.4	59.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	281,000	-2.43	417.6	100.1	45,743	-7,935	0.04%	118	-6,146	6,373	4,994	2,537
기아차	90,400	0.44	929.7	95.3	265,887	72,725	0.21%	-19,076	38,700	-18,376	-43,817	-18,659
삼성전기	215,500	-0.46	133.5	94.7	32,025	-2,419	0.02%	35	-975	933	1,771	-488
NAVER	342,000	0.00	347.8	91.5	60,273	-524	0.03%	181	-734	525	375	-116
현대차	244,000	-2.79	485.2	91.4	78,403	-2,653	-0.35%	4,065	-7,392	3,503	12,825	3,170
카카오	465,000	0.65	299.7	91.3	34,674	973	0.03%	305	-1,640	1,406	328	23
엔씨소프트	981,000	2.51	85.2	84.9	3,913	1,056	0.05%	322	-11	-363	-283	-873
SK 하이닉스	129,500	0.39	521.0	82.6	335,324	9,449	0.22%	2,144	-4,383	2,464	-2,432	-8,778
삼성 SDI	796,000	0.63	294.7	81.3	24,830	-1,009	0.10%	-169	-928	1,169	541	964
현대건설	43,100	-1.82	28.6	73.3	23,773	-5,488	-0.11%	3,691	223	-4,188	855	1,137

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터