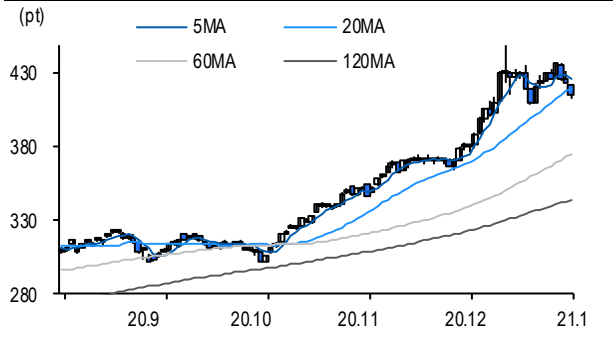


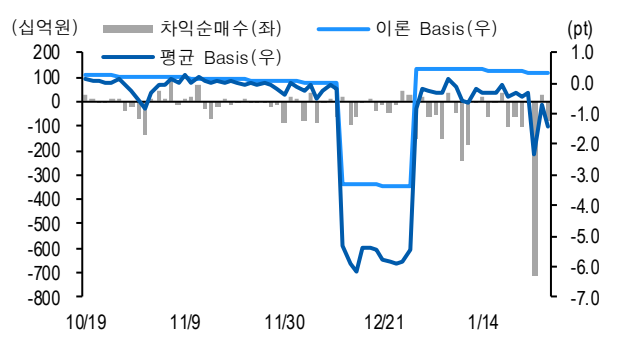


선물옵션시장 지표 2021.1.29

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	416.40	-1.72	-7.27	17,045.0	-
선물 3월물	414.05	-2.10	-8.90	43,043.9	237,250
선물 6월물	413.70	-2.07	-8.75	182.0	18,211
2월물(mini)	414.20	-2.13	-9.00	7,127.3	100,718
3월물(mini)	414.12	-2.09	-9.12	237.5	34,648

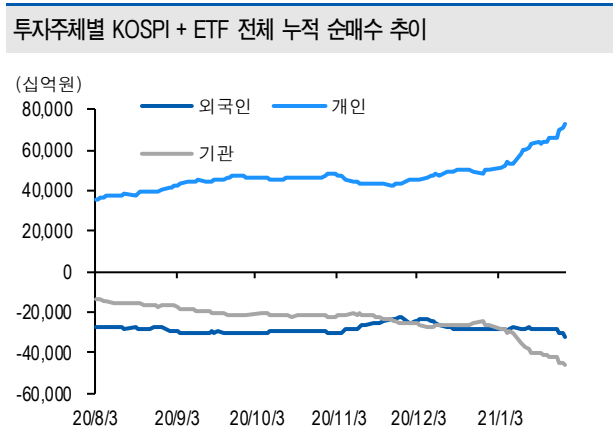


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.34	-1.44	-2.35	-0.43%	
베이스스(mini)	0.10	-1.27	-2.20	-0.33%	
제1스프레드(SP)	0.12	-0.47	-0.50	-0.14%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.10	-2.24	-2.24	-0.56%	

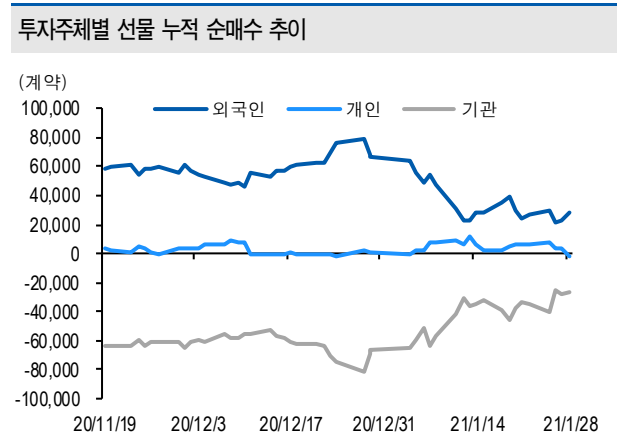


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-1,567.0	3.2	-1,563.8	-1.0	-1,225.5	558.3	8.5	1.0	-3.0	10.2	
개인	1,929.4	88.8	2,018.2	0.0	-1.6	-521.8	-26.4	-4.5	3.9	-14.9	
기관	-379.4	-95.3	-474.7	-76.5	-74.3	132.7	17.2	3.4	-3.5	13.3	
금융투자	-113.9	-519.2	-633.0	-41.8	-33.7	69.7	17.0	3.5	-4.5	111.7	
투신	63.2	147.3	210.5	-12.0	57.5	-31.9	0.0	-0.1	0.1	-110.1	
은행+보험+기타금융	-17.8	243.0	225.3	0.0	-5.8	47.0	0.1	0.0	0.9	0.8	
연기금+국가지자체	-259.9	5.2	-254.8	-20.7	-87.3	47.9	0.0	0.0	0.0	10.9	
기타법인	17.0	3.3	20.3	0.0	0.7	-169.2	0.7	0.1	2.6	-8.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





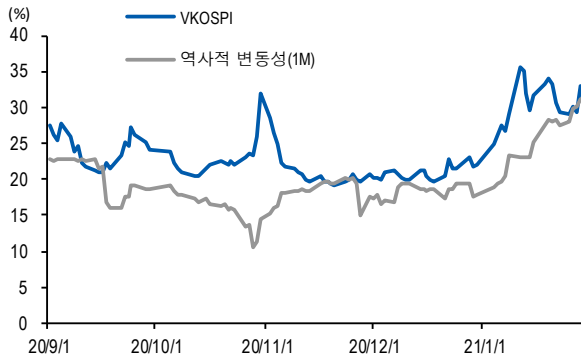
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,290,793	475.5	666,641	26.6%	지수옵션 전체	2,700,590	1,096.0	2,200,829
Put	1,409,797	620.5	1,534,188	33.8%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	33.09%(+3.68%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	3.64	-2.32	34,377	8,724	1,128	26.6	Put	425.0(K+1)	15.75	5.81	727	3,698	-276	33.4
	427.5(K+2)	4.36	-2.61	17,235	3,771	233	26.6		422.5(K+0)	14.35	5.67	1,220	5,007	19	33.9
	425.0(K+1)	5.14	-2.95	16,783	5,926	499	26.6		420.0(K-1)	12.90	5.32	2,571	5,441	-49	33.9
	422.5(K+0)	6.01	-3.35	6,280	3,191	-16	26.5		417.5(K-2)	11.40	4.78	3,313	3,168	109	33.5
	420.0(K-1)	7.04	-3.76	6,464	5,595	1,377	26.5		415.0(K-3)	10.25	4.52	5,513	4,452	-461	33.8

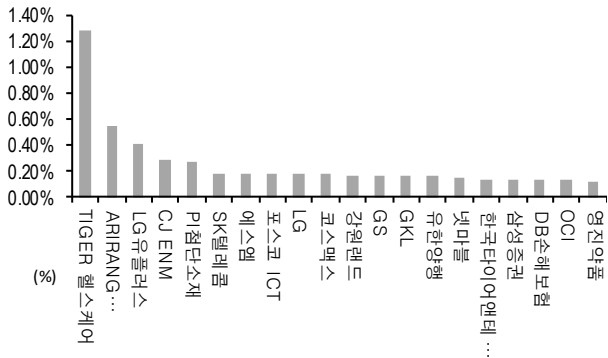
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,392,825	7,781.2	7,714,542	-166,070	30,499	-117,921	112,043	10.2	-14.9	13.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 이노베이션	276,000	-1.78	313.9	97.2	44,119	-1,624	0.06%	46	-1,313	1,278	2,135	-714
엔씨소프트	971,000	-1.02	88.9	92.9	4,160	247	0.04%	-270	259	19	-136	112
카카오	458,000	-1.51	376.9	89.1	35,014	340	0.05%	-152	759	-608	-1,291	-198
삼성전기	209,000	-3.02	169.9	87.3	32,546	521	0.11%	-1,330	6,175	-4,901	-2,695	-3,340
현대모비스	330,000	0.61	213.7	83.7	20,558	2,597	0.06%	138	-719	654	-1,340	-539
기아차	88,300	-2.32	515.9	82.7	234,404	-31,483	0.10%	-6,631	-24,234	30,821	10,553	25,354
삼성 SDI	768,000	-3.52	467.8	81.7	24,501	-329	0.03%	-210	-227	377	2,092	1,123
NAVER	355,500	3.95	600.0	74.5	73,210	12,937	0.09%	1,130	6,748	-8,009	-4,308	-8,238
하나금융지주	34,400	-2.82	39.9	71.4	110,277	2,915	0.05%	-1,935	3,654	-1,738	1,041	-2,790
현대차	239,500	-1.84	335.2	68.9	73,881	-4,522	-0.04%	646	1,460	-2,286	-3,371	-2,301

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터