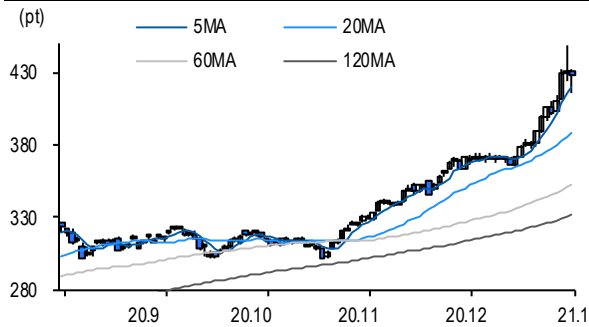


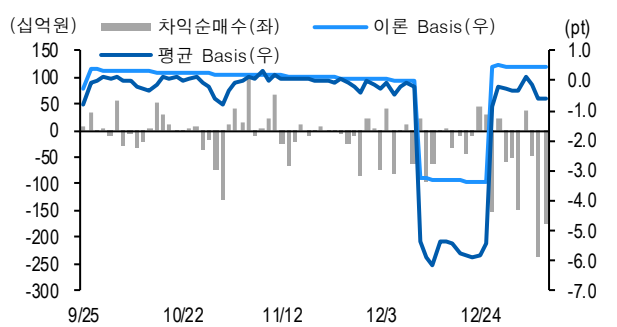
선물옵션시장 지표

2021.1.13

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	427.87	-0.76	-3.26	24,371.0	-
선물 3월물	427.70	-1.12	-4.85	55,953.3	232,698
선물 6월물	427.45	-0.78	-3.35	27.4	16,804
1월물(mini)	428.18	-1.10	-4.76	8,611.2	146,140
2월물(mini)	427.78	-1.09	-4.72	375.6	29,817



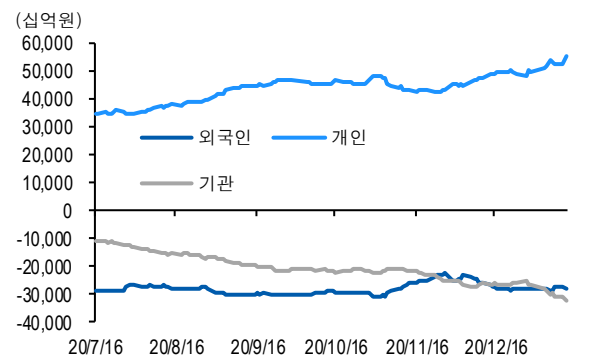
차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.45	-0.63	-0.17	-0.25%	
베이스(mini)	0.02	-0.18	0.31	-0.05%	
제1스프레드(SP)	0.09	-0.23	-0.20	-0.08%	
합성선물 베이스(ATM)	0.02	0.29	0.29	0.06%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-619.5	8.0	-611.5	-15.7	-303.1	-52.3	-691.7	131.3	8.8	-33.8	
개인	2,313.1	-99.8	2,213.3	0.0	-5.9	-311.0	41.3	-129.5	-8.9	12.6	
기관	-1,723.9	119.1	-1,604.8	-161.0	-564.2	443.7	650.9	2.1	-1.6	18.4	
금융투자	-948.8	-24.1	-972.9	-138.2	-63.4	442.3	649.4	4.2	-2.9	188.8	
투신	-279.4	50.2	-229.2	-21.2	-185.4	-123.9	-1.3	-0.5	-0.2	-127.0	
은행+보험+기타금융	-117.8	124.1	6.3	0.0	-71.7	59.2	2.9	-1.6	1.5	8.9	
연기금+국가자재	-287.8	1.8	-286.0	-1.7	-209.0	66.2	0.0	0.0	0.0	-52.3	
기타법인	30.3	-27.4	3.0	0.0	-0.1	-80.4	-0.4	-3.9	1.7	2.8	

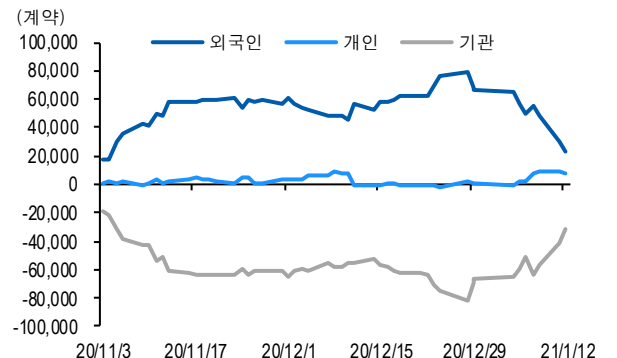
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이





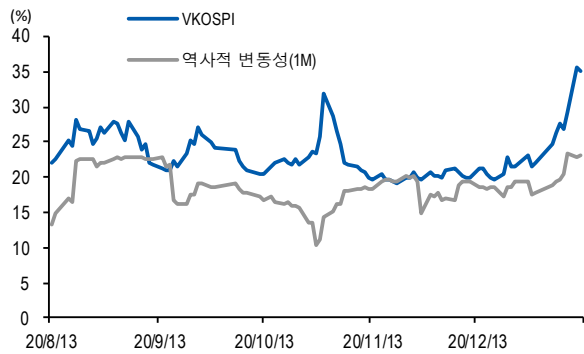
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	3,054,986	1,210.0	891,542	44.5%	지수옵션 전체	6,015,613	2,171.8	2,881,101		
Put	2,960,627	961.8	1,989,559	43.0%	PCR(금액기준)	0.79	VKOSPI	34.95%(-0.70%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	3.20	-2.96	102,609	9,427	1,918	44.6	Put	432.5(K+1)	9.22	1.26	1,099	2,248	-122	42.8
	435.0(K+2)	3.96	-3.31	93,900	8,644	2,279	44.5		430.0(K+0)	7.78	0.97	5,759	5,717	250	43.0
	432.5(K+1)	4.83	-3.64	64,693	6,466	-538	44.3		427.5(K-1)	6.47	0.65	10,790	3,081	996	43.1
	430.0(K+0)	5.94	-3.87	86,733	14,259	3,980	44.8		425.0(K-2)	5.28	0.35	11,865	4,283	700	43.0
	427.5(K-1)	7.08	-4.27	26,053	9,753	1,626	44.5		422.5(K-3)	4.28	0.11	27,115	3,637	-807	43.1

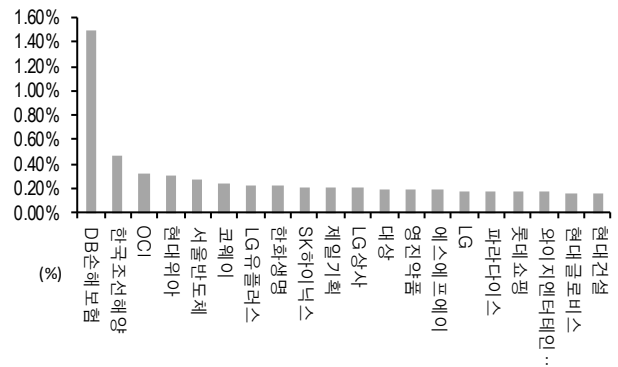
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	9,817,822	11,068.0	7,550,520	21,995	-14,745	-1,811	13,423	-33.8	12.6	18.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	970,000	-2.81	556.6	80.2	17,136	-2,448	0.09%	-584	-106	663	641	440
KB 금융	46,350	0.76	149.7	78.0	95,384	11,622	0.06%	-2,253	-6,386	8,794	-5,912	-9,652
삼성전기	193,500	0.00	132.7	73.2	29,577	-3,992	0.10%	43	-3,141	3,171	4,218	-507
한국금융지주	85,800	-3.27	62.8	69.2	30,708	-19,324	-0.04%	-3,220	-6,435	9,811	14,670	5,313
SK 이노베이션	286,000	-2.89	448.8	67.4	47,517	-19,960	0.05%	-1,619	3,233	-1,639	5,945	100
삼성 SDI	744,000	1.36	457.0	66.4	13,529	-465	0.04%	-529	1,015	-653	-308	-404
삼성전자	90,800	-0.55	2,738.9	62.9	807,063	-127,899	0.02%	-19,230	9,637	9,617	50,342	-22,595
현대모비스	333,000	-5.93	386.2	61.5	22,748	-14,213	0.01%	-185	-5,009	5,161	10,902	3,190
SK 하이닉스	129,000	-3.37	686.0	61.2	232,295	-21,593	0.21%	6,332	2,893	-8,947	-5,212	-1,143
기아차	70,500	0.28	235.4	58.5	46,239	-8,271	-0.01%	-3,015	12,196	-9,156	8,308	-3,078

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터