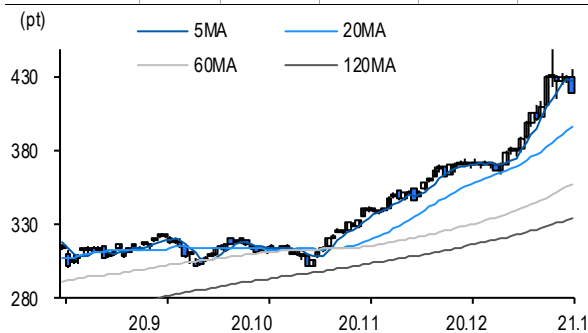


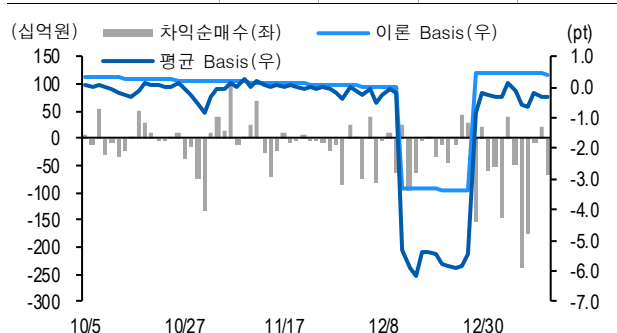
선물옵션시장 지표

2021.1.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	420.43	-2.19	-9.42	17,133.3	-
선물 3월물	419.40	-2.50	-10.75	40,743.2	224,680
선물 6월물	418.95	-2.55	-10.95	33.7	17,652
2월물(mini)	419.50	-2.49	-10.72	6,628.9	65,620
3월물(mini)	416.48	-3.18	-13.68	656.9	17,117



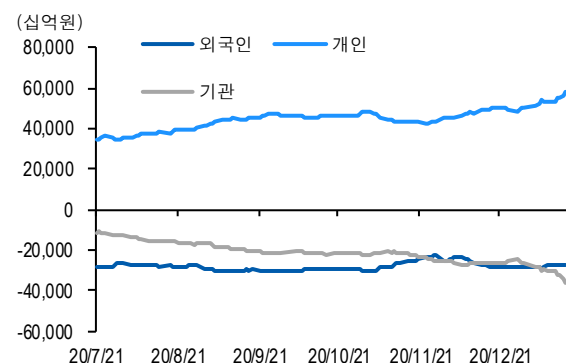
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.42	-0.33	-1.03	-0.18%
베이스(mini)	0.20	-0.19	-0.93	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.09	-0.36	-0.30	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	0.20	-0.80	-0.80	-0.24%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-759.6	-27.3	-786.8	0.0	-495.4	361.2	-330.2	-2.2	6.1	-14.5
개인	2,134.4	124.2	2,258.7	0.0	-2.2	-357.4	10.1	3.7	-0.6	-236.6
기관	-1,415.0	-104.6	-1,519.6	-65.0	-367.2	-104.9	317.7	1.9	-4.2	259.9
금융투자	-637.1	-280.6	-917.7	-16.9	-41.1	344.6	317.4	3.4	-2.3	286.5
투신	-136.5	12.9	-123.6	-10.6	-64.9	-447.3	0.4	-1.4	-1.7	-97.7
은행+보험+기타금융	-73.6	158.9	85.2	-10.6	-39.1	-1.0	0.0	0.0	-0.2	2.3
연기금+국가자재	-520.4	8.2	-512.2	-27.0	-216.1	-1.2	-0.1	0.0	0.0	68.8
기타법인	40.1	7.6	47.8	0.0	0.6	101.0	2.4	-3.4	-1.3	-8.8

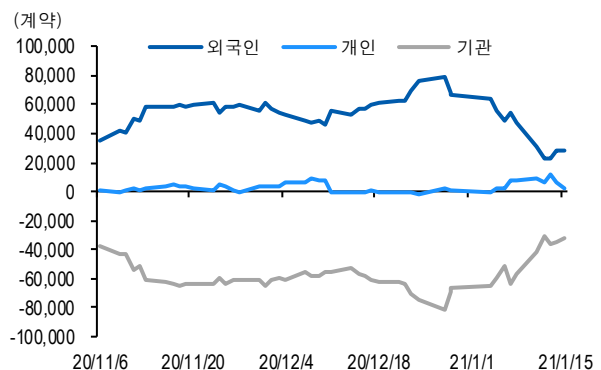
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



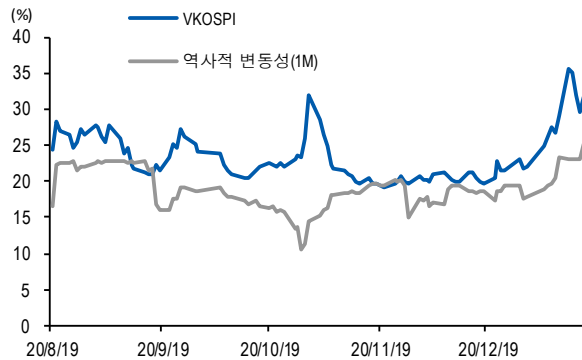
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	602,771	401.0	487,742	26.9%	지수옵션 전체	1,885,072	949.2	1,514,779
Put	1,282,301	548.3	1,027,037	29.8%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	31.56%(+1.88%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	437.5(K+3)	5.86	-3.32	3,732	2,180	468	26.9	Put	432.5(K+1)	20.45	7.00	768	1,102	431	29.7
	435.0(K+2)	6.65	-3.60	6,787	2,422	934	27.0		430.0(K+0)	18.80	6.65	2,232	2,096	765	29.5
	432.5(K+1)	7.49	-4.01	2,801	4,699	1,891	27.1		427.5(K-1)	17.35	6.35	1,652	1,845	1,199	29.7
	430.0(K+0)	8.43	-4.32	4,661	5,095	948	27.2		425.0(K-2)	16.00	5.95	3,077	1,901	682	29.9
	427.5(K-1)	9.43	-4.12	1,782	2,144	951	27.3		422.5(K-3)	14.60	5.47	4,087	2,726	366	29.9

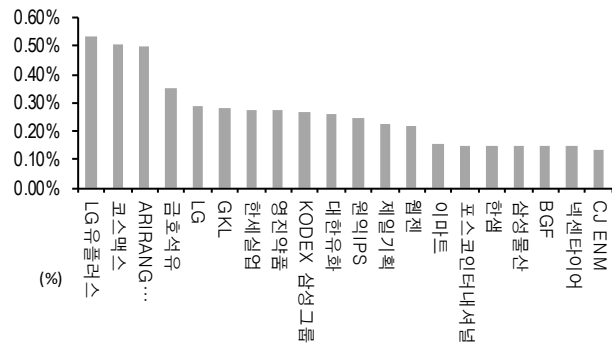
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	6,860,054	7,553.8	6,497,531	-160,291	-64,476	-198,925	268,949	-14.5	-236.6	259.9		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한국금융지주	85,900	-2.94	43.8	92.1	52,957	-684	0.07%	-1,461	1,845	-384	991	958
삼성 SDI	731,000	-2.92	349.2	88.3	20,275	365	-0.01%	163	-271	117	111	879
LG 화학	977,000	-4.59	363.8	82.8	16,286	-1,200	-0.03%	-686	-120	994	1,029	1,039
삼성전자	87,900	-1.79	2,231.4	75.4	1,219,540	-109,481	0.02%	-5,713	-169,346	178,253	111,584	34,992
SK 이노베이션	262,000	-0.76	305.9	75.2	44,495	-6,737	0.00%	582	-3,125	2,880	4,155	982
현대모비스	320,000	-2.74	183.5	73.7	22,755	-113	0.02%	624	-494	-95	504	-317
기아차	71,100	-4.69	228.7	71.6	122,985	-38,624	-0.06%	-5,015	5,919	-676	27,911	7,300
SK 하이닉스	127,500	-2.67	443.3	71.5	264,843	-3,757	0.13%	-876	-7,333	8,408	6,095	-2,123
엔씨소프트	944,000	0.00	72.6	70.2	2,630	-292	0.03%	44	33	-93	205	-166
현대차	239,000	-4.97	640.5	67.3	83,164	-16,965	-0.05%	3,172	-19,785	16,967	12,606	1,995

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터