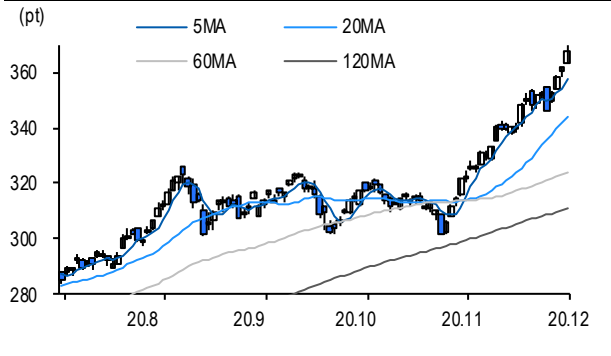


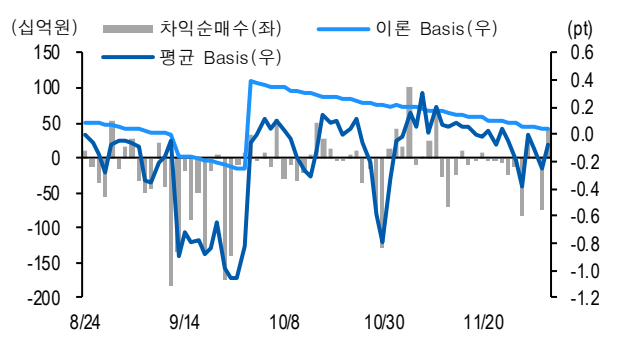


선물옵션시장 지표 2020.12.7

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	367.63	1.65	5.97	13,986.3	-
선물 12월물	368.10	1.88	6.80	39,064.0	266,308
선물 3월물	363.95	1.99	7.10	955.8	36,712
12월물(mini)	368.10	1.88	6.72	3,778.3	181,027
1월물(mini)	363.66	1.87	6.66	140.1	29,423

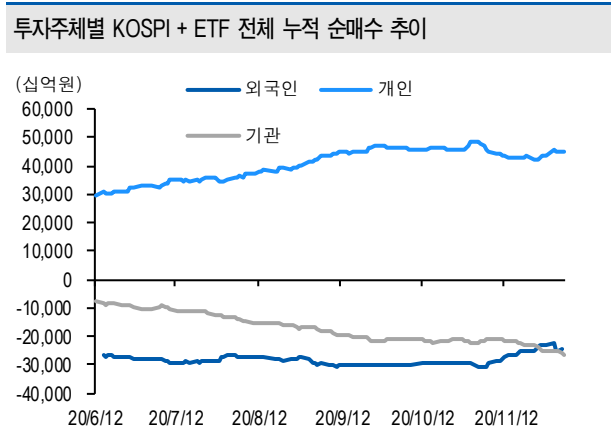


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.04	-0.07	0.47	-0.03%
베이스스(mini)	0.04	-0.07	0.47	-0.03%
제1스프레드(SP)	-3.34	-4.37	-4.35	-0.28%
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	0.43	0.43	0.11%

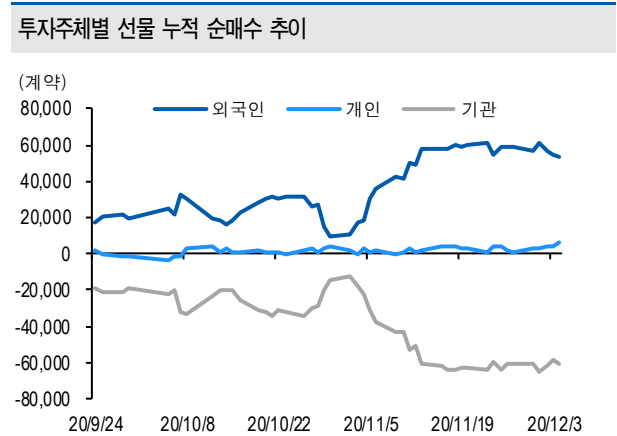


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	761.0	84.5	845.5	0.0	496.1	-233.5	97.9	-17.8	0.6	-8.6
개인	-343.2	87.1	-256.1	0.0	-2.4	221.0	18.1	11.6	-0.2	-24.7
기관	-410.1	-172.2	-582.3	40.5	-397.2	-7.7	-117.0	3.9	0.0	31.0
금융투자	36.5	106.4	142.9	-7.3	-7.4	-155.7	-117.5	2.9	-0.1	53.7
투신	-62.4	-81.4	-143.8	0.0	-33.3	215.4	0.5	0.5	0.1	-88.0
은행+보험+기타금융	-111.2	-202.5	-313.7	0.0	-79.6	-23.9	0.0	0.5	0.0	0.3
연기금+국가자재	-232.6	-5.5	-238.1	47.8	-242.7	-43.6	0.0	0.0	0.0	65.0
기타법인	-7.7	0.6	-7.1	0.0	3.0	20.2	1.0	2.3	-0.4	2.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





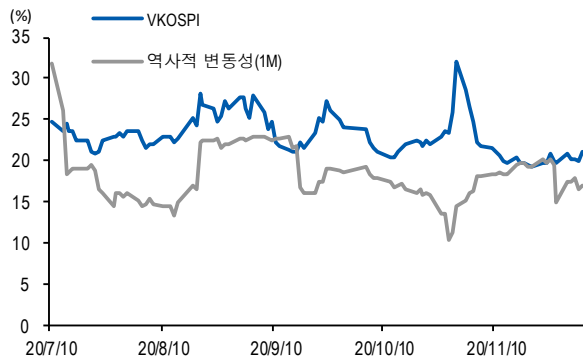
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,983,188	929.8	896,876	18.6%	지수옵션 전체	4,912,792	1,357.1	2,871,102
Put	1,929,604	427.3	1,974,226	18.6%	PCR(금액기준)	0.46	VKOSPI	21.01%(+0.99%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	2.70	1.78	210,095	17,574	-2,757	18.4	Put	365.0(K+1)	2.27	-3.58	91,191	6,867	6,273	17.0
	367.5(K+2)	3.80	2.38	120,068	13,358	-2,026	18.3		362.5(K+0)	1.54	-2.78	141,993	7,515	6,455	17.6
	365.0(K+1)	5.22	3.06	51,652	12,287	-3,412	18.4		360.0(K-1)	1.00	-2.10	200,209	14,703	10,383	18.0
	362.5(K+0)	7.10	3.99	23,885	11,568	-3,490	19.8		357.5(K-2)	0.66	-1.59	171,008	15,010	8,574	18.7
	360.0(K-1)	9.09	4.69	13,504	14,696	-3,188	20.8		355.0(K-3)	0.45	-1.08	185,008	19,241	9,377	19.6

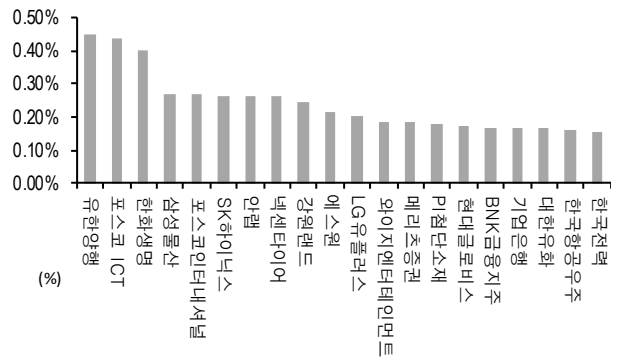
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,612,726	5,229.8	6,928,815	-95,657	-28,006	2,134	23,676	-8.6	-24.7	31.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,000	3.15	1,507.5	75.0	1,303,685	-82,314	0.06%	6,599	-25,406	18,989	28,089	24,572
기아차	65,600	0.92	174.8	69.0	180,833	-46,907	0.03%	21,139	-2,334	-18,723	-5,362	19,012
LG 화학	842,000	-0.71	214.4	67.0	28,137	-1,647	-0.36%	-1,758	62	1,667	2,801	1,097
현대차	196,500	-0.25	374.6	58.9	100,017	-24,222	0.06%	-2,656	-8,247	11,258	12,122	5,417
KB 금융	47,300	0.32	45.9	55.7	62,536	-2,860	0.08%	5,561	-8,684	3,768	86	-3,537
SK 하이닉스	117,000	4.46	506.6	52.9	286,431	-19,787	0.27%	4,121	1,749	-6,578	-2,033	8,826
하나금융지주	36,550	1.81	33.6	51.6	75,557	-2,135	0.06%	-2,032	-2,941	7,324	-1,599	4,193
삼성전기	162,500	-0.31	50.1	45.1	36,605	-3,581	0.06%	409	-154	119	-2,006	3,168
LG 전자	90,800	0.55	71.0	44.6	63,965	-239	-0.10%	-214	3,604	-3,392	-3,471	-741
SK 이노베이션	179,000	-0.83	85.2	43.7	67,389	-8,272	0.03%	-928	-1,146	2,199	1,185	6,867

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터