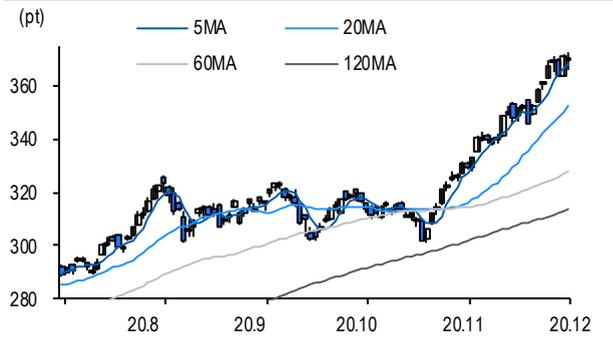


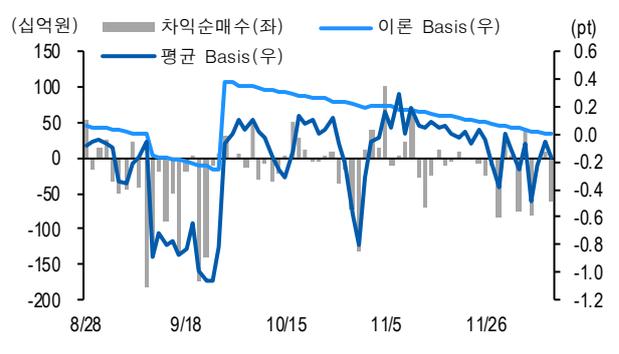


선물옵션시장 지표 2020.12.11

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	369.37	-0.57	-2.10	15,117.9	-
선물 12월물	370.30	-0.26	-0.95	24,563.9	0
선물 3월물	363.55	-0.74	-2.70	16,544.5	219,855
12월물(mini)	370.14	-0.30	-1.04	2,958.8	0
1월물(mini)	363.60	-0.85	-3.12	2,169.4	29,566

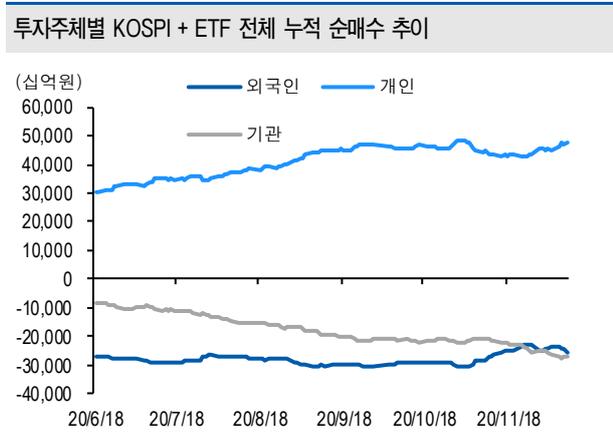


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.00	-0.17	0.93	-0.05%
베이스스(mini)	0.00	-0.18	0.77	-0.05%
제1스프레드(SP)	-3.33	-5.55	-6.05	-0.60%
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	0.87	0.87	0.24%

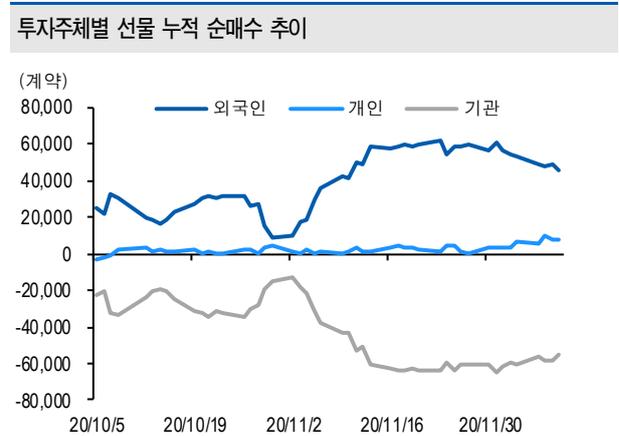


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,364.0	-24.6	-1,388.6	-4.6	-895.7	-315.8	25.4	-11.0	-2.1	85.5
개인	892.2	36.6	928.8	0.0	-2.7	78.1	-15.5	2.0	2.0	16.9
기관	443.5	-4.0	439.5	-56.9	990.8	268.4	-13.2	9.0	-0.8	-101.5
금융투자	924.4	-96.6	827.8	0.1	1,219.2	514.3	-13.1	1.4	-0.1	62.4
투신	-111.2	21.1	-90.1	-15.1	-103.9	-339.7	-0.1	-0.6	-0.1	-125.5
은행+보험+기타금융	25.9	54.8	80.7	0.0	10.5	-9.0	0.0	8.2	-0.6	0.4
연기금+국가자재	-397.6	16.5	-381.1	-41.9	-134.5	102.9	0.0	0.0	0.0	-38.7
기타법인	28.2	-8.0	20.2	0.0	0.4	-30.7	3.3	0.1	0.9	-0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	3,173,841	635.2	381,085	14.0%	지수옵션 전체	6,389,448	1,106.3	1,046,874
Put	3,215,607	471.1	665,789	8.7%	PCR(금액기준)	0.74	VKOSPI	20.03%(-0.12%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	0.01	-0.09	145,231	0	-35,024	22.1	Put	375.0(K+1)	4.42	0.06	14,841	0	-817	15.6
	377.5(K+2)	0.01	-0.23	250,708	0	-27,446	17.5		372.5(K+0)	2.30	-0.30	178,804	0	-3,477	15.2
	375.0(K+1)	0.01	-0.61	656,553	0	-24,800	12.7		370.0(K-1)	0.32	-1.01	505,989	0	-9,340	2.2
	372.5(K+0)	0.04	-1.32	928,048	0	-26,145	9.8		367.5(K-2)	0.05	-0.57	766,171	0	-13,915	7.0
	370.0(K-1)	0.62	-1.95	636,113	0	-20,749	11.6		365.0(K-3)	0.01	-0.28	572,100	0	-24,140	10.4

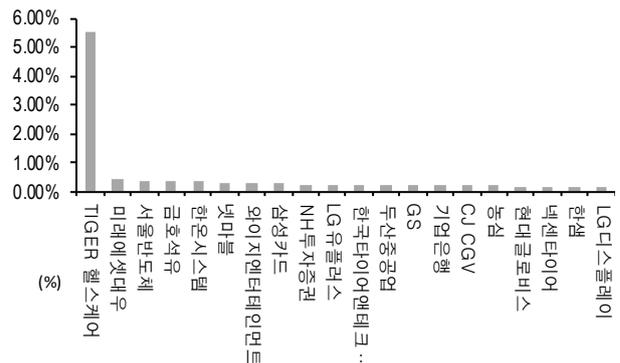
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	8,508,889	6,839.3	5,020,248	-1,998,218	45,543	36,196	-67,884	85.5	16.9	-101.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	73,300	-0.95	1,268.6	43.6	0	-817,056	-0.02%	3,699	1,036	-4,603	30,302	6,760
기아차	63,800	-0.16	85.5	42.1	0	-121,070	-0.09%	590	-180	-407	3,414	8,867
LG 전자	95,600	-0.73	64.1	39.9	0	-78,699	-0.02%	1,539	-2,720	1,128	-439	3,267
SK 하이닉스	117,000	-3.31	335.5	35.0	0	-255,435	-0.08%	801	6,768	-7,545	21,626	-8,420
LG 화학	819,000	-2.27	174.9	35.0	0	-17,216	-0.06%	6,220	531	-6,746	-1,680	-3,358
웹젠	34,250	0.44	2.2	30.6	0	-4,394	-0.54%	578	219	-794	-822	0
한화솔루션	45,500	-2.67	33.1	30.6	0	-58,178	-0.06%	-1,587	-349	2,028	-2,357	5,439
현대차	192,500	0.26	126.0	30.1	0	-47,526	-0.06%	-1,080	-307	1,352	2,279	-1,936
SK 이노베이션	190,000	2.43	122.3	29.6	0	-58,545	-0.10%	-1,962	5,643	-4,315	6,812	2,995
삼성전기	164,500	1.23	45.9	29.1	0	-27,779	-0.04%	3,172	-184	-2,999	-1,221	-1,874

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

