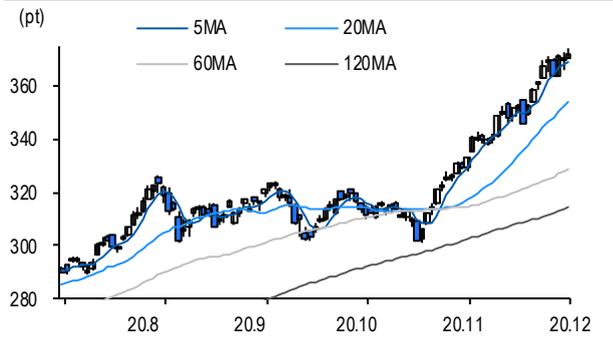


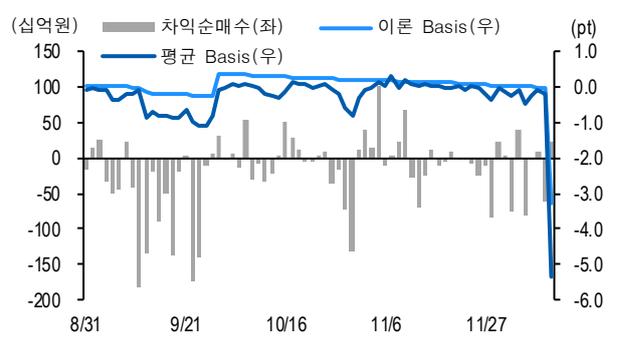


선물옵션시장 지표 2020.12.14

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	372.24	0.78	2.87	14,477.3	-
선물 12월물	367.65	1.13	4.10	26,742.8	221,049
선물 3월물	366.75	1.10	4.00	11.7	14,669
12월물(mini)	367.44	1.06	3.84	3,330.1	44,302
1월물(mini)	366.62	0.86	3.12	10.9	225

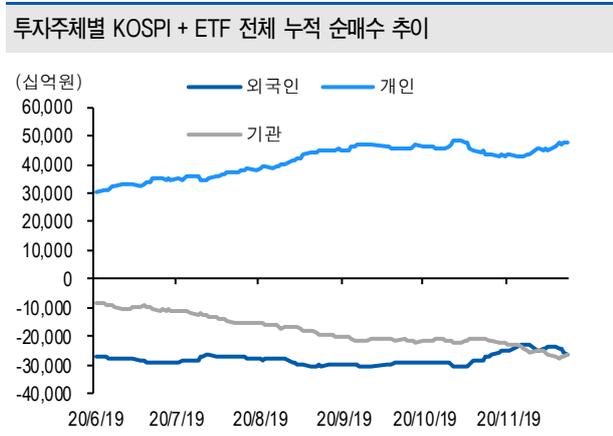


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-3.28	-5.35	-4.59	-0.55%
베이스스(mini)	-2.23	-5.38	-4.80	-0.84%
제1스프레드(SP)	0.00	-0.29	-0.45	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	-2.23	-4.68	-4.68	-0.66%

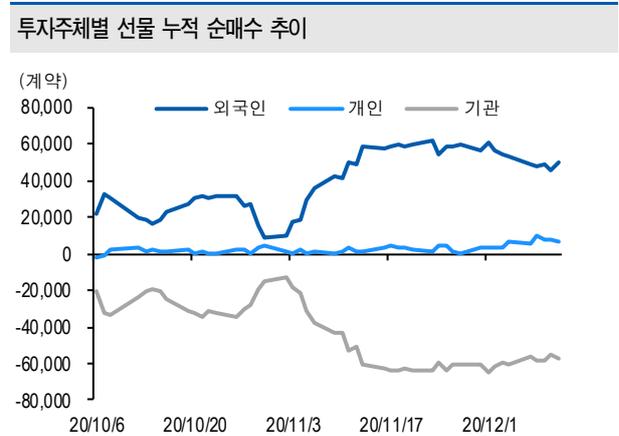


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-162.7	-365.7	-528.4	0.0	-8.0	165.4	222.3	-2.2	0.7	62.4
개인	-47.7	5.0	-42.6	0.0	2.0	-136.4	-7.3	2.0	-1.3	86.6
기관	210.1	364.5	574.6	23.7	-113.7	-29.3	-203.7	0.2	1.1	-148.9
금융투자	297.2	393.8	691.0	-0.2	6.4	-49.9	-203.4	2.3	2.9	-63.3
투신	-95.1	-26.4	-121.4	1.5	-52.9	209.2	-0.3	-1.9	-1.6	-24.0
은행+보험+기타금융	-33.0	26.3	-6.7	0.0	-13.2	-47.1	-0.1	-0.3	-0.2	3.0
연기금+국가자재	42.6	-9.1	33.4	22.4	-59.0	-141.5	0.0	0.0	0.0	-64.5
기타법인	0.3	-3.8	-3.5	0.0	-0.4	0.3	-11.2	0.0	-0.5	-0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	650,816	356.7	434,863	16.8%	지수옵션 전체	1,351,452	660.8	1,190,477			
Put	700,636	304.1	755,614	19.2%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	19.85%(-0.18%p)			

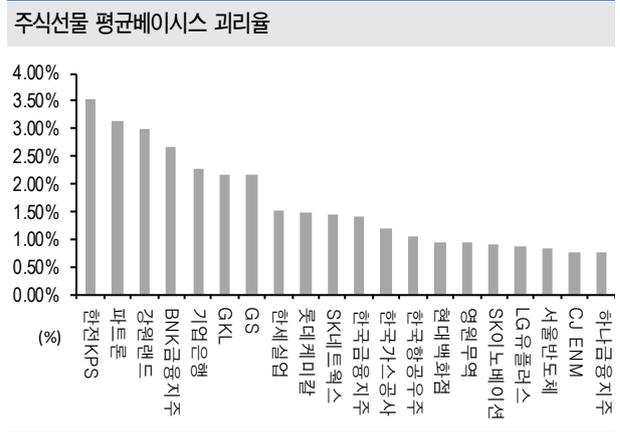
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	377.5(K+3)	4.10	1.08	30,672	3,303	716	16.8	Put	372.5(K+1)	11.00	-2.90	577	391	266	19.5
	375.0(K+2)	4.92	1.27	30,815	4,614	1,006	16.8		370.0(K+0)	9.36	-2.49	1,458	902	583	19.0
	372.5(K+1)	5.86	1.52	21,236	4,003	1,377	16.7		367.5(K-1)	8.09	-1.91	6,126	2,021	1,373	19.0
	370.0(K+0)	6.92	1.75	15,379	6,028	1,230	16.7		365.0(K-2)	6.93	-1.92	8,741	3,537	678	19.0
	367.5(K-1)	8.12	1.92	5,882	2,802	775	16.6		362.5(K-3)	5.96	-1.68	9,726	2,635	241	19.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	4,329,351	3,195.5	5,411,637	391,389	91,212	112,800	-202,956	62.4	86.6	-148.9		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 디스플레이	16,200	3.85	39.5	71.8	373,094	18,126	-3.71%	-3,449	-12,387	15,841	3,570	2,742
삼성전자	72,400	0.56	892.3	65.8	1,221,037	46,645	-1.16%	39,087	-6,509	-32,639	-40,639	6,110
SK 이노베이션	188,500	-1.31	144.6	59.5	72,375	12,243	0.90%	-601	8,029	-8,047	-1,954	-8,291
SK 하이닉스	115,000	-0.43	268.5	58.6	273,828	-3,147	0.06%	-2,291	9,947	-7,189	-1,335	2,711
셀트리온	362,500	0.55	222.7	54.7	48,842	-118	-0.26%	-202	-999	1,155	2,783	0
카카오	374,500	0.81	83.4	50.7	27,680	1,834	0.03%	520	1,492	-1,639	19	-1,662
LG 전자	95,600	0.42	48.7	50.2	75,663	6,836	0.19%	253	3,416	-3,675	-8,331	3,122
삼성전기	166,000	0.91	62.5	49.4	36,320	3,076	0.39%	-540	2,205	-1,937	-259	-1,867
NAVER	291,000	1.22	71.4	48.9	25,139	2,062	0.14%	3,486	830	-4,355	-534	-3,908
한국금융지주	77,200	1.31	12.1	44.8	36,345	1,863	1.40%	379	1,156	-1,532	-1,522	-8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터