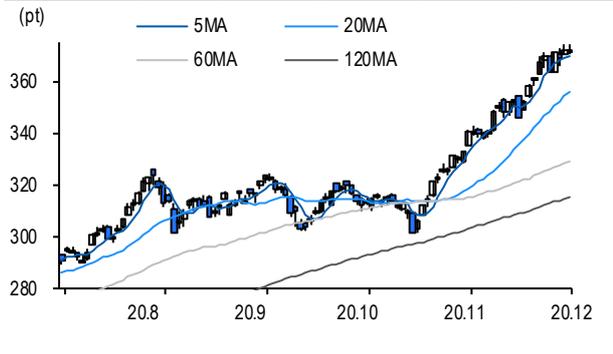


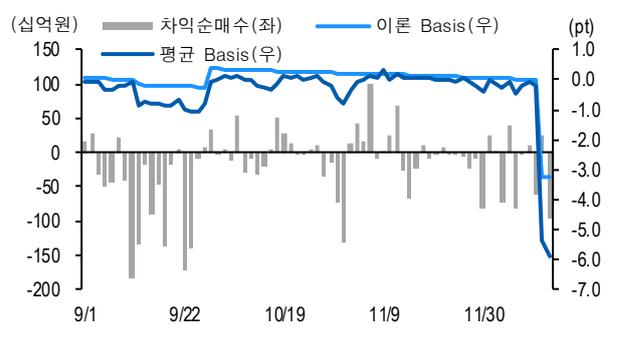


선물옵션시장 지표 2020.12.15

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	371.56	-0.18	-0.68	12,239.0	-
3월물(big)	365.30	-0.64	-2.35	23,401.0	222,588
6월물(big)	365.20	-0.42	-1.55	43.0	14,406
1월물(mini)	365.48	-0.53	-1.96	3,150.7	30,994
2월물(mini)	365.24	-0.38	-1.38	12.6	450

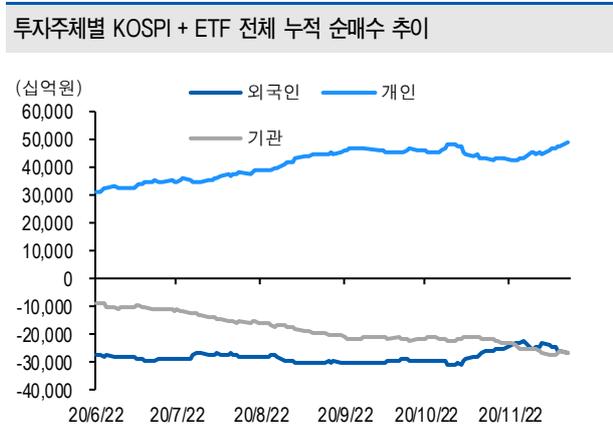


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	-3.28	-5.35	-6.26	-0.56%	
베이스스(mini)	-2.23	-5.38	-6.08	-0.85%	
제1스프레드(SP)	0.00	-0.29	-0.25	-0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	-2.23	-4.68	-5.94	-0.66%	

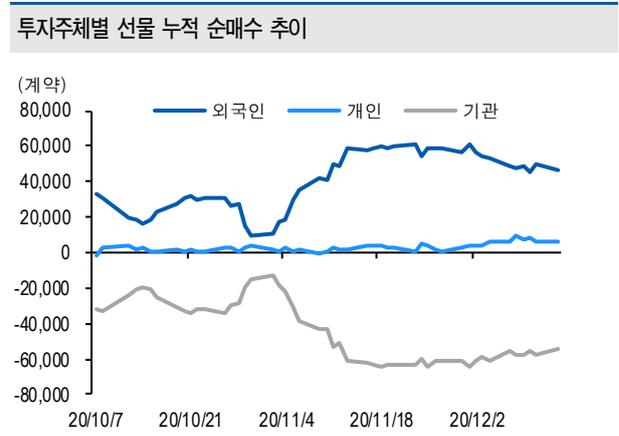


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.9	-426.4	-785.3	-9.5	-100.7	68.8	-368.6	-4.0	-1.3	-16.8
개인	1,033.4	58.6	1,092.0	0.0	-2.2	5.0	10.0	3.5	0.9	45.5
기관	-703.3	363.2	-340.1	-86.7	-160.3	-93.6	353.7	1.0	0.9	-28.7
금융투자	-421.0	283.6	-137.3	-61.4	-45.6	19.3	353.6	1.7	1.1	-22.8
투신	-62.4	31.5	-30.9	-0.1	-34.3	10.3	0.1	-0.9	-0.1	11.0
은행+보험+기타금융	-63.6	49.3	-14.3	-2.9	-37.4	-95.6	-0.1	0.2	-0.2	1.8
연기금+국가지자체	-130.4	0.1	-130.3	-22.4	-41.3	-27.6	0.0	0.0	0.0	-18.7
기타법인	28.8	4.6	33.4	0.0	-0.4	19.8	5.0	-0.5	-0.5	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

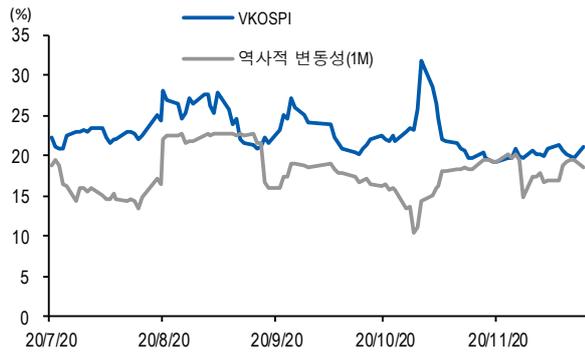
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	512,602	252.8	460,122	16.9%	지수옵션 전체	1,214,605	564.8	1,280,751
Put	702,003	312.0	820,629	21.7%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	21.25%(+1.40%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	3.00	-0.42	31,667	6,478	550	17.1	Put	375.0(K+1)	13.65	1.10	152	309	78	22.2
	377.5(K+2)	3.60	-0.50	17,071	3,880	577	16.9		372.5(K+0)	12.05	1.05	399	576	185	22.0
	375.0(K+1)	4.34	-0.58	14,083	5,221	607	16.7		370.0(K-1)	10.40	1.04	802	1,194	292	21.4
	372.5(K+0)	5.17	-0.69	7,787	4,433	430	16.5		367.5(K-2)	9.23	1.14	3,902	2,574	553	21.8
	370.0(K-1)	6.12	-0.80	4,958	6,501	473	16.3		365.0(K-3)	7.99	1.06	5,907	4,397	860	21.7

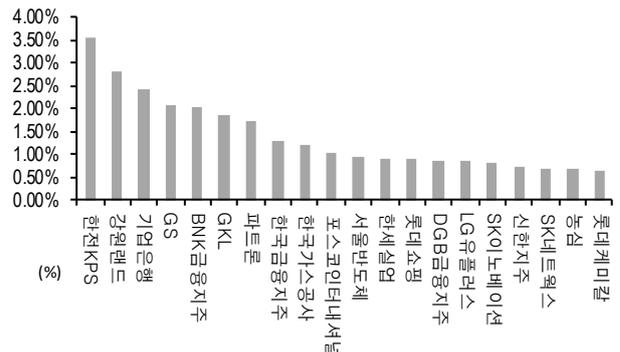
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,570,442	3,109.6	5,509,610	97,973	-35,218	49,667	-11,815	-16.8	45.5	-28.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,500	0.14	1,070.6	67.3	1,230,641	9,604	-1.17%	9,846	1,749	-12,857	-11,087	-8,200
한화솔루션	45,900	-0.65	46.4	56.4	84,111	-1,682	0.12%	1,664	-278	-2,036	759	1,692
카카오	374,500	0.00	91.1	50.5	28,888	1,208	0.05%	-2,749	847	1,599	197	731
SK 이노베이션	184,000	-2.39	96.3	50.0	75,246	2,871	0.83%	844	1,978	-2,847	-3,311	-465
SK 하이닉스	116,500	1.30	175.3	48.8	291,350	17,522	0.43%	-4,020	14,879	-11,052	-5,789	-9,987
셀트리온	357,500	-1.38	290.5	47.9	50,750	1,908	-0.20%	748	698	-1,507	-1,781	0
LG 디스플레이	16,550	2.16	23.1	47.5	395,957	22,863	-1.91%	-4,976	-617	5,594	606	-2,872
LG 전자	94,100	-1.57	44.9	46.7	77,227	1,564	0.13%	-10	2,459	-2,449	-3,533	1,530
현대모비스	256,000	6.00	143.2	45.3	17,959	7,586	0.30%	1,361	1,407	-2,767	-510	-4,939
NAVER	287,000	-1.37	72.2	45.0	25,670	531	0.19%	-1,006	1,030	-24	384	-549

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

