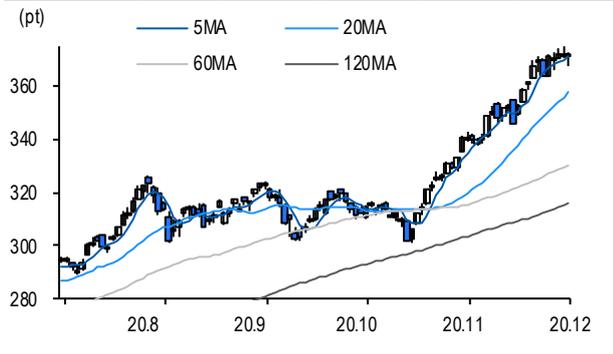


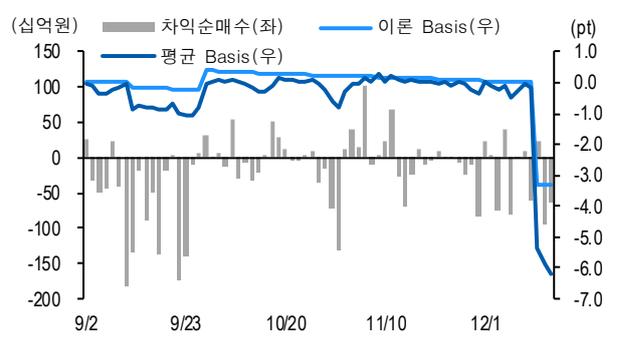


**선물옵션시장 지표** 2020.12.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	370.88	-0.18	-0.68	10,755.6	-
선물 12월물	365.30	0.00	0.00	28,148.0	227,335
선물 3월물	364.85	-0.10	-0.35	10.0	14,417
12월물(mini)	365.36	-0.03	-0.12	3,446.9	36,957
1월물(mini)	365.20	-0.01	-0.04	14.6	517

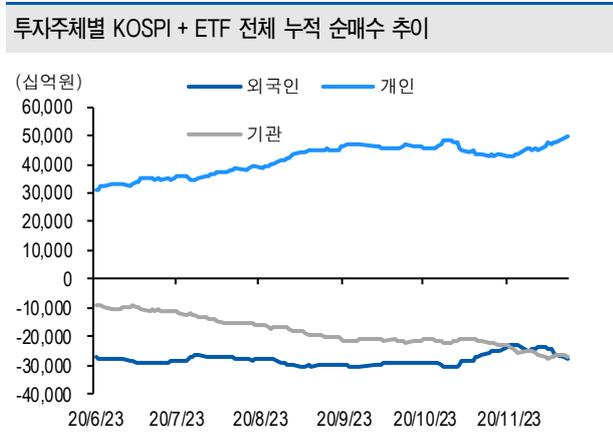


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-3.31	-6.20	-5.58	-0.78%
베이스(mini)	-2.25	-6.08	-5.52	-1.03%
제1스프레드(SP)	-0.01	-0.24	-0.25	-0.06%
합성선물 베이스(ATM)	-2.25	-5.58	-5.58	-0.90%

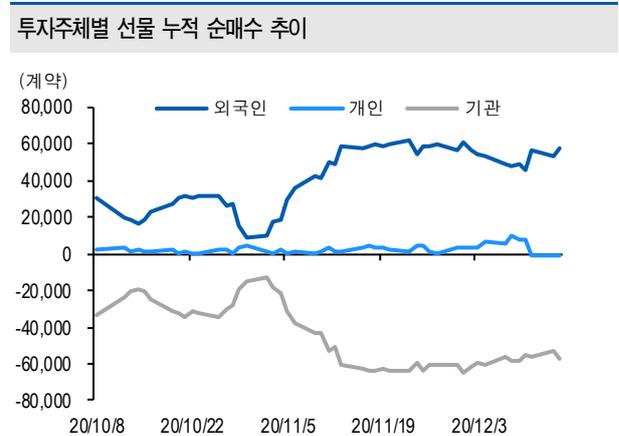


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-373.6	-319.3	-692.9	-49.3	-131.0	334.9	96.1	-3.4	1.5	3.0
개인	607.7	15.1	622.8	0.0	-0.1	-38.6	-16.0	1.2	-1.0	-27.9
기관	-237.5	308.0	70.5	-14.8	-185.7	-293.1	-85.4	1.7	-0.5	26.1
금융투자	-6.0	252.4	246.4	-64.6	-46.0	-138.2	-85.1	2.6	-0.9	3.4
투신	-53.5	-7.0	-60.5	0.0	-14.4	-81.4	-0.2	-0.9	0.0	-28.2
은행+보험+기타금융	-49.1	37.6	-11.5	0.0	-39.3	-22.0	-0.1	0.0	0.4	0.2
연기금+국가자재	-86.2	-0.5	-86.7	49.8	-67.0	-51.5	0.0	0.0	0.0	50.8
기타법인	3.4	-3.8	-0.4	0.0	0.2	-3.1	5.2	0.4	0.0	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

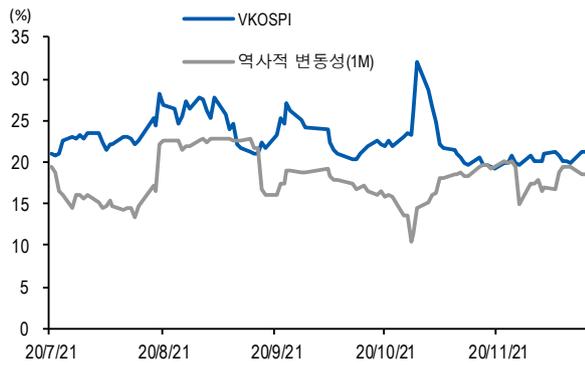
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	819,832	459.5	489,252	17.0%	지수옵션 전체	1,740,972	901.3	1,364,784
Put	921,140	441.7	875,532	21.2%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	21.27%(+0.02%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	2.74	-0.26	77,636	8,396	1,918	17.1	Put	375.0(K+1)	13.50	-0.15	73	348	39	21.1
	377.5(K+2)	3.36	-0.24	38,898	4,774	894	17.1		372.5(K+0)	12.10	0.05	229	664	88	21.5
	375.0(K+1)	4.04	-0.30	29,775	5,735	514	16.9		370.0(K-1)	10.60	0.20	504	1,333	139	21.4
	372.5(K+0)	4.90	-0.27	20,619	4,716	283	16.8		367.5(K-2)	9.18	-0.05	656	2,781	207	21.2
	370.0(K-1)	5.88	-0.24	13,453	7,043	542	16.7		365.0(K-3)	7.94	-0.05	4,673	4,905	508	21.2

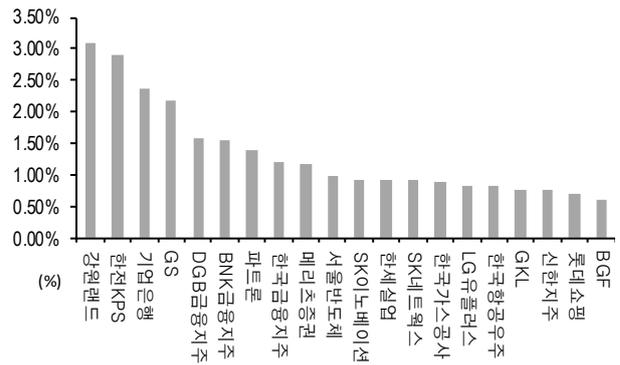
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,829,070	3,204.0	5,581,185	71,575	10,446	-18,621	6,208	3.0	-27.9	26.1

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	0.00	1,008.1	65.5	1,234,589	3,948	-1.48%	-3,695	-13,779	17,630	-22,962	41,578
SK 이노베이션	185,000	0.54	102.1	64.3	75,203	-43	0.93%	-1,469	792	494	-1,993	2,125
카카오	370,500	-1.07	79.9	54.7	27,797	-1,091	0.01%	-177	-672	904	219	682
SK 하이닉스	117,000	0.43	169.6	52.8	300,597	9,247	0.31%	4,345	3,579	-7,903	-11,444	649
셀트리온	362,000	1.26	436.7	51.0	50,435	-315	-0.19%	593	-1,347	733	2,130	0
LG 전자	92,900	-1.28	51.8	50.5	74,690	-2,537	0.11%	-1,009	-932	2,031	3,029	1,837
엔씨소프트	872,000	-0.91	32.7	50.1	2,182	-77	-0.07%	-233	2	251	104	183
현대모비스	256,000	0.00	73.4	49.7	16,591	-1,368	0.22%	-1,731	-291	2,022	-814	2,287
한화솔루션	45,150	-1.63	36.3	49.2	84,374	263	0.00%	-1,108	-181	1,288	1,939	5,378
KB 금융	44,100	-1.56	28.2	41.5	41,117	150	-0.09%	-15,307	-422	15,729	12,896	73

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터