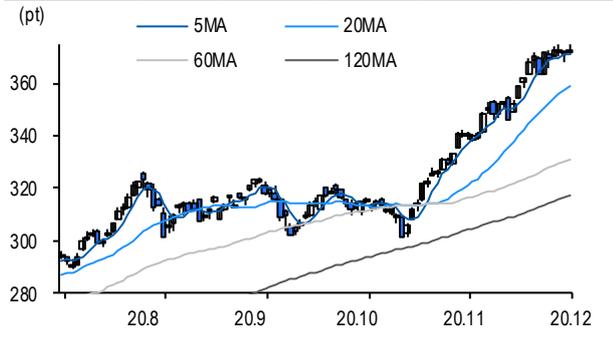


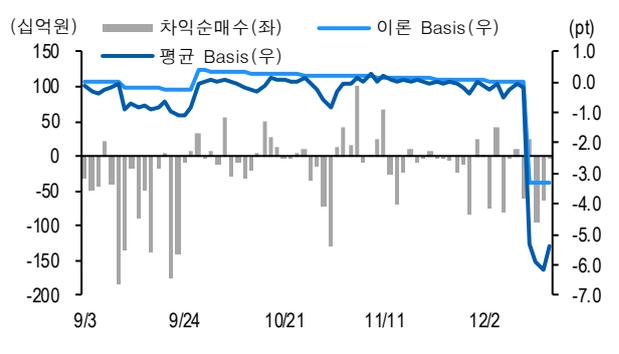


선물옵션시장 지표 2020.12.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	372.53	0.44	1.65	8,792.6	-
선물 12월물	367.30	0.55	2.00	19,228.2	224,410
선물 3월물	367.15	0.63	2.30	10.7	14,433
12월물(mini)	367.10	0.48	1.74	2,492.0	48,239
1월물(mini)	367.16	0.54	1.96	12.9	437

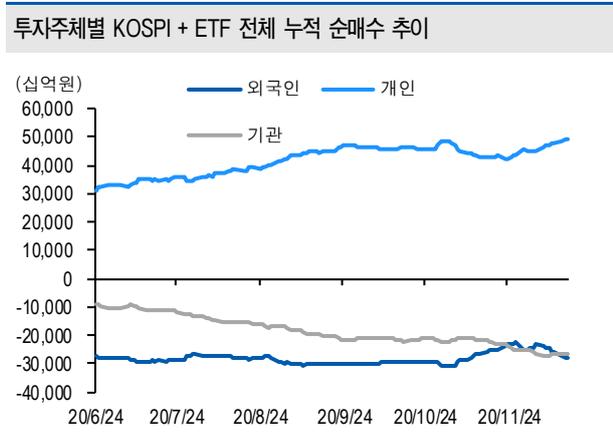


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-3.32	-5.40	-5.23	-0.56%
베이스스(mini)	-2.27	-5.50	-5.43	-0.87%
제1스프레드(SP)	0.00	-0.22	-0.15	-0.06%
합성선물 베이스스(ATM)	-2.27	-5.40	-5.40	-0.84%

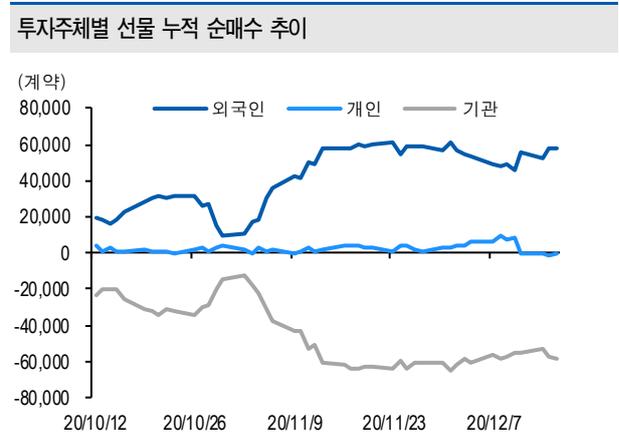


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-43.3	0.4	-42.9	0.0	-81.7	-210.5	211.0	1.6	-0.2	1.7
개인	-139.3	-66.5	-205.8	0.0	-5.8	92.6	22.5	0.9	-0.1	53.8
기관	198.2	59.7	258.0	-3.7	-110.5	139.2	-219.7	-0.7	0.6	-57.0
금융투자	315.7	104.0	419.7	0.0	1.1	75.0	-219.4	-0.4	0.3	-47.3
투신	-25.3	30.0	4.7	0.0	-11.6	64.1	-0.2	-0.4	0.0	26.5
은행+보험+기타금융	-69.8	-79.7	-149.5	0.0	-49.6	-3.0	0.0	0.1	0.3	0.5
연기금+국가자재	-10.6	-6.8	-17.4	-3.7	-38.6	3.2	0.0	0.0	0.0	-36.7
기타법인	-15.6	6.3	-9.3	0.0	-3.0	-21.4	-13.8	-1.9	-0.3	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	582,941	239.0	516,649	16.3%	지수옵션 전체	1,262,735	473.0	1,446,183
Put	679,794	233.9	929,534	20.4%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	20.40%(-0.87%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	377.5(K+3)	3.55	0.19	16,731	4,967	193	16.5	Put	372.5(K+1)	10.55	-1.55	613	880	216	20.4
	375.0(K+2)	4.31	0.27	14,076	5,743	8	16.3		370.0(K+0)	9.13	-1.47	2,254	1,672	339	20.3
	372.5(K+1)	5.22	0.32	9,054	4,901	185	16.2		367.5(K-1)	7.88	-1.30	2,710	3,307	526	20.3
	370.0(K+0)	6.26	0.38	8,846	7,620	577	16.1		365.0(K-2)	6.72	-1.22	5,548	5,473	568	20.3
	367.5(K-1)	7.41	0.43	4,462	4,296	604	15.9		362.5(K-3)	5.72	-1.10	6,380	3,850	216	20.4

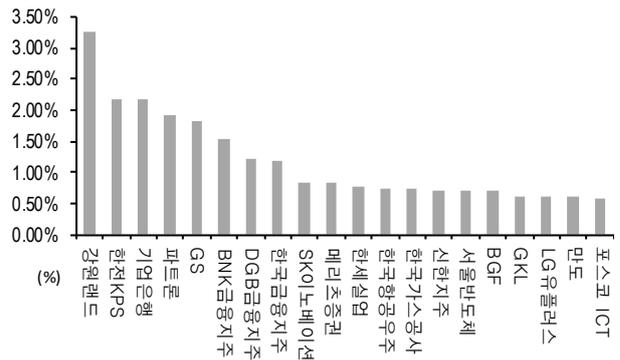
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,415,674	2,793.9	5,717,750	136,565	-25,712	63,626	-40,818	1.7	53.8	-57.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,500	0.00	983.5	76.7	1,252,820	18,231	-1.44%	-2,913	16,653	-13,387	-449	-17,271
기아차	61,800	0.49	52.0	61.1	117,238	5,026	0.44%	1,434	3,413	-4,871	-715	-5,590
삼성전기	169,000	2.11	60.0	60.4	40,404	1,922	0.31%	-2,026	2,988	-988	-1,689	-330
LG 화학	809,000	2.66	144.4	57.7	18,946	756	-1.21%	257	46	-286	75	-797
LG 전자	96,800	4.20	97.5	56.6	81,519	6,829	0.11%	3,047	2,410	-5,776	-2,848	-5,616
현대차	187,000	0.27	135.7	56.3	75,482	3,047	0.01%	-3,480	3,738	-301	-1,046	435
SK 하이닉스	117,000	0.00	145.6	56.1	307,437	6,840	0.44%	-58	2,799	-2,941	-7,789	-530
SK 이노베이션	189,500	2.43	75.0	55.6	77,123	1,920	0.85%	2,948	-285	-2,712	-3,159	-445
현대모비스	251,500	-1.76	51.5	47.1	15,016	-1,575	0.04%	-1,071	-1,161	2,233	-499	2,650
LG 이노텍	168,000	3.70	30.1	42.5	16,396	3,038	0.05%	-666	2,130	-1,500	-2,088	-1,561

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터