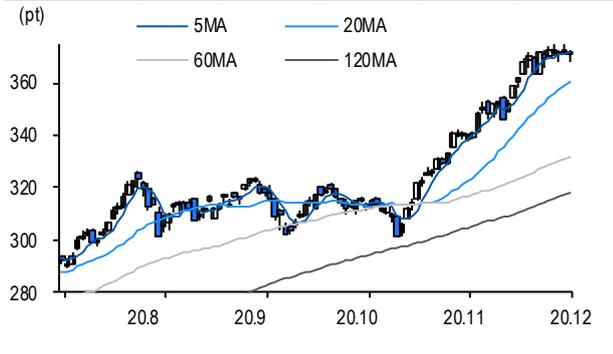


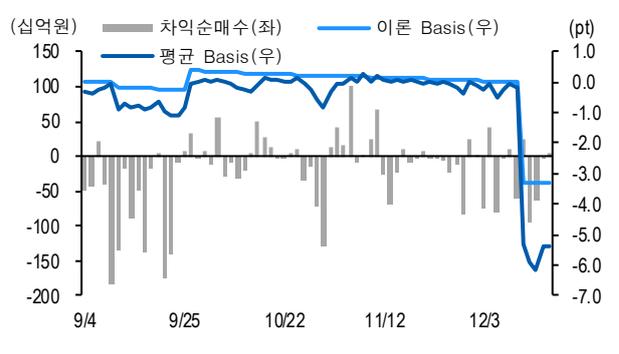


선물옵션시장 지표 2020.12.18

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	372.00	-0.14	-0.53	11,223.3	-
선물 12월물	366.85	-0.12	-0.45	24,625.3	226,730
선물 3월물	366.45	-0.19	-0.70	7.8	14,443
12월물(mini)	366.58	-0.14	-0.52	2,934.7	57,702
1월물(mini)	366.56	-0.16	-0.60	17.5	715

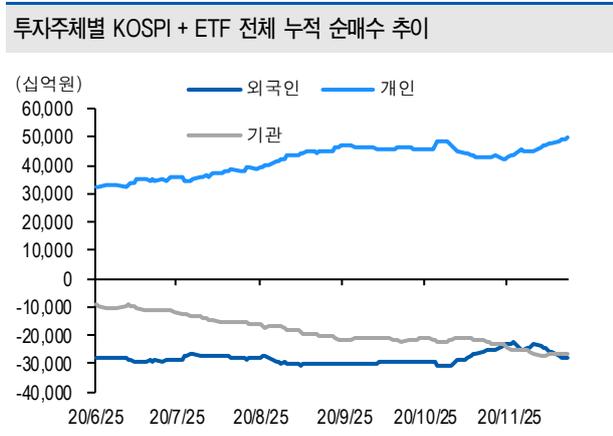


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	-3.32	-5.36	-5.15	-0.55%	
베이스스(mini)	-2.27	-5.48	-5.42	-0.86%	
제1스프레드(SP)	-0.01	-0.21	-0.30	-0.05%	
합성선물 베이스스(ATM)	-2.27	-5.44	-5.44	-0.85%	

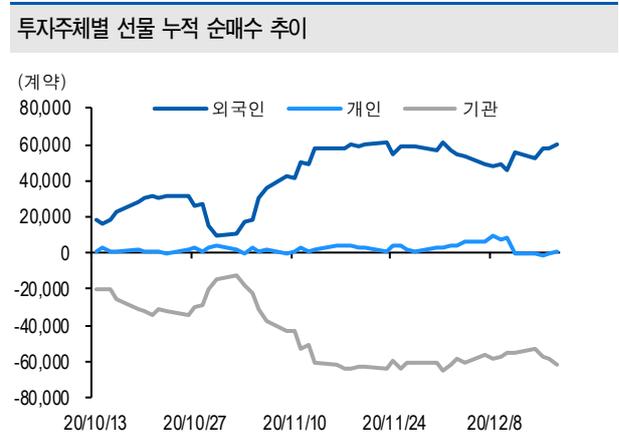


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-300.6	-16.5	-317.1	-18.7	-153.0	6.1	190.3	-1.8	2.2	-16.3
개인	325.8	32.5	358.4	0.0	-4.6	69.2	7.7	1.1	-2.3	24.5
기관	-32.2	-16.0	-48.2	22.2	-162.4	-104.6	-207.5	0.8	0.2	-10.4
금융투자	219.9	26.9	246.8	0.0	-9.4	-101.8	-207.0	1.4	0.3	-32.8
투신	-73.3	-0.7	-74.0	0.0	-53.1	61.1	-0.6	-0.6	0.0	28.4
은행+보험+기타금융	-39.6	-46.1	-85.8	0.0	-18.0	-18.4	0.0	0.0	0.0	0.9
연기금+국가자재	-69.1	1.1	-68.0	22.2	-53.3	-45.5	0.0	0.0	0.0	-6.9
기타법인	6.9	0.0	6.9	0.0	-0.3	29.3	9.6	0.0	-0.1	2.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	757,147	280.6	532,502	15.8%	지수옵션 전체	1,511,980	579.2	1,508,689
Put	754,833	298.6	976,187	19.7%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	19.85%(-0.55%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	2.47	-0.43	70,195	12,036	841	16.1	Put	375.0(K+1)	12.45	0.30	91	397	32	20.9
	377.5(K+2)	3.06	-0.49	46,467	6,410	1,443	15.9		372.5(K+0)	10.55	0.00	467	1,011	131	20.0
	375.0(K+1)	3.78	-0.53	33,266	5,946	203	15.7		370.0(K-1)	9.06	-0.07	2,672	2,116	444	19.8
	372.5(K+0)	4.61	-0.61	22,275	4,731	-170	15.5		367.5(K-2)	7.70	-0.18	4,411	3,391	84	19.6
	370.0(K-1)	5.67	-0.59	14,780	8,077	457	15.6		365.0(K-3)	6.54	-0.18	5,975	5,877	404	19.7

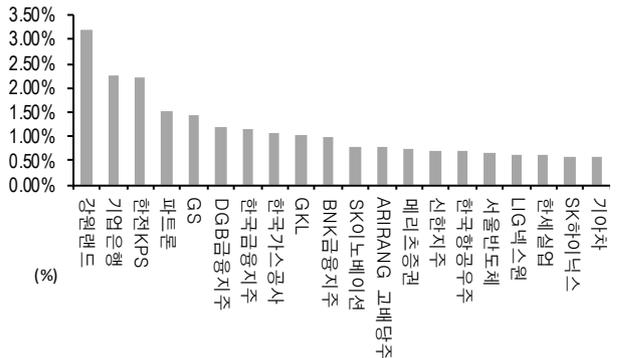
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,243,883	3,072.0	5,907,768	190,018	-23,994	61,250	-43,478	-16.3	24.5	-10.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,000	-0.69	1,163.8	67.7	1,255,640	2,820	-1.43%	-6,153	18,613	-13,200	4,441	-18,629
LG 전자	96,400	-0.41	64.1	63.8	77,318	-4,201	0.12%	-2,840	-1,288	4,409	231	4,220
SK 이노베이션	192,500	1.58	82.9	58.4	76,612	-511	0.79%	-422	-1,160	1,361	907	-202
셀트리온	352,500	-0.42	185.0	58.1	50,963	170	-0.17%	311	78	-384	-1,897	0
SK 하이닉스	119,500	2.14	234.9	54.5	322,832	15,395	0.58%	-664	7,465	-6,842	-9,741	-2,514
기아차	61,600	-0.32	37.8	46.0	119,659	2,421	0.58%	1,511	2,432	-3,943	-3,361	-468
한화솔루션	47,400	-1.86	75.3	43.7	88,919	-12,814	0.01%	-14,001	-3,585	17,903	18,110	-341
LG 이노텍	167,500	-0.30	16.3	41.6	17,173	777	0.02%	475	299	-764	84	-744
POSCO	266,500	-0.56	48.0	41.5	9,655	2,036	0.06%	1,223	365	-1,609	-500	-1,182
삼성 SDI	566,000	0.53	74.2	41.0	14,559	89	-0.01%	-751	787	-149	-32	195

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터