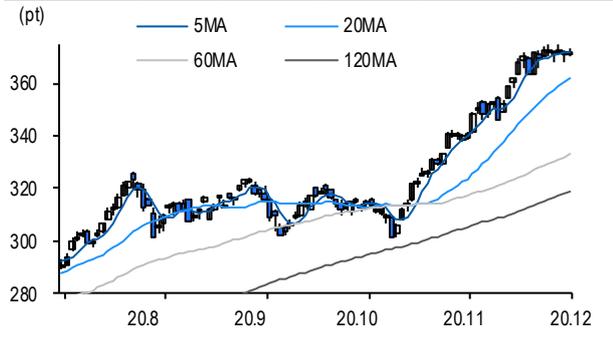


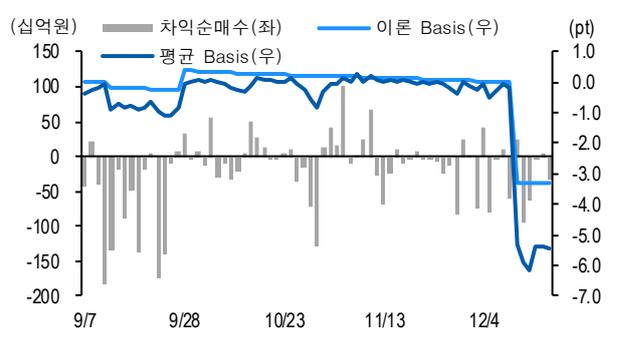


선물옵션시장 지표 2020.12.21

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	371.55	-0.12	-0.45	13,406.5	-
선물 12월물	366.30	-0.15	-0.55	19,214.9	226,823
선물 3월물	366.20	-0.07	-0.25	9.3	14,246
12월물(mini)	366.22	-0.10	-0.36	2,750.1	67,847
1월물(mini)	366.48	-0.02	-0.08	12.8	731

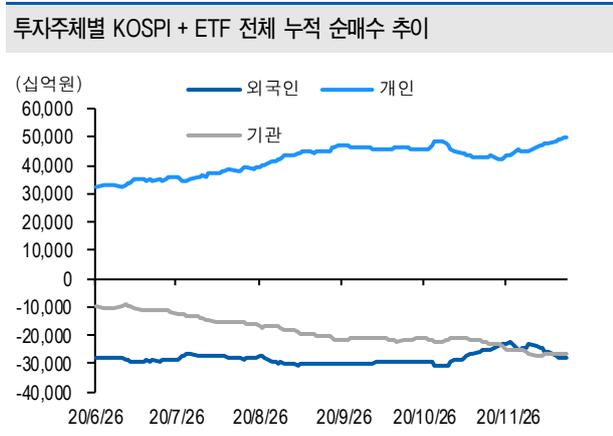


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-3.33	-5.47	-5.25	-0.58%	
베이스스(mini)	-2.28	-5.54	-5.33	-0.88%	
제1스프레드(SP)	-0.01	-0.36	-0.35	-0.10%	
합성선물 베이스스(ATM)	-2.28	-5.38	-5.38	-0.84%	

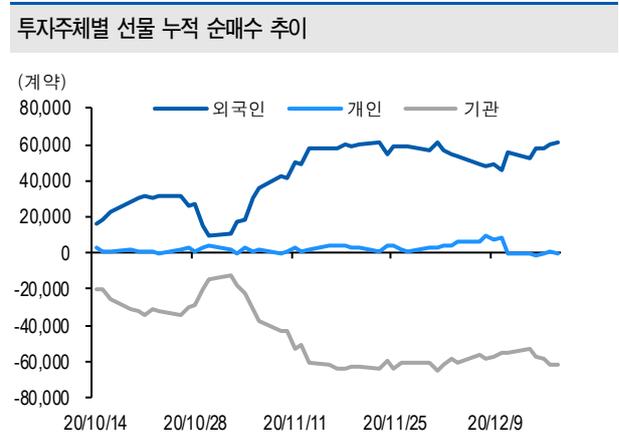


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-191.8	16.2	-175.6	-20.1	-144.5	235.8	-46.6	1.3	-0.9	15.8
개인	387.8	-2.6	385.2	0.0	-6.6	-110.1	-0.2	-1.4	0.7	-6.5
기관	-150.0	-10.9	-160.9	-13.5	-47.5	-104.7	35.4	0.5	0.5	-10.3
금융투자	52.0	3.2	55.2	0.0	78.2	62.4	35.3	0.5	0.6	5.8
투신	-76.2	-1.2	-77.4	0.0	-57.7	-168.1	0.1	0.1	0.0	2.8
은행+보험+기타금융	-18.6	-5.6	-24.2	-0.5	-12.4	-12.7	0.0	-0.1	-0.1	0.1
연기금+국가자재	-81.3	-1.3	-82.6	-13.0	-46.4	13.7	0.0	0.0	0.0	-19.0
기타법인	-45.9	-2.8	-48.7	0.0	-0.5	-20.9	11.4	-0.4	-0.3	1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	464,372	187.7	545,374	15.5%	지수옵션 전체	1,029,640	371.1	1,573,611
Put	565,268	183.4	1,028,237	19.2%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	19.57%(-0.28%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	2.11	-0.36	50,832	12,221	185	15.6	Put	375.0(K+1)	12.15	-0.30	127	480	83	19.8
	377.5(K+2)	2.69	-0.37	31,818	7,165	755	15.5		372.5(K+0)	10.55	0.00	333	1,094	83	19.7
	375.0(K+1)	3.39	-0.39	22,610	6,180	234	15.4		370.0(K-1)	8.95	-0.11	1,143	2,438	322	19.3
	372.5(K+0)	4.22	-0.39	10,060	5,050	319	15.3		367.5(K-2)	7.58	-0.12	2,064	3,740	349	19.2
	370.0(K-1)	5.20	-0.47	7,176	8,447	370	15.2		365.0(K-3)	6.40	-0.14	6,464	6,521	644	19.2

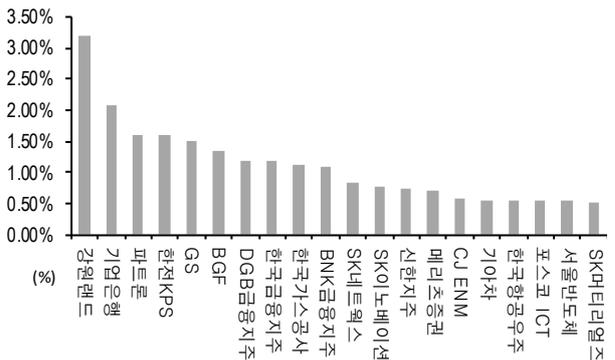
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,678,603	2,655.0	6,014,606	106,838	17,567	-46,970	23,358	15.8	-6.5	-10.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,300	0.42	732.0	57.3	1,251,809	-3,831	-1.37%	28,688	-20,805	-7,109	15,101	-23,000
LG 화학	806,000	-1.59	152.9	53.3	18,808	-567	-1.03%	1,531	-244	-1,299	-1,036	-120
SK 이노베이션	189,000	-1.82	54.3	53.1	75,176	-1,436	0.78%	-1,993	453	1,550	1,900	657
SK 하이닉스	118,000	-1.26	162.2	45.9	335,808	12,976	0.38%	-4,875	730	4,155	-1,251	-1,484
한국전력	27,750	7.98	592.9	45.6	319,781	15,934	-2.22%	8,159	-68,713	60,986	67,797	-7,968
삼성전기	167,500	-1.76	34.0	44.9	38,038	-1,293	0.14%	-1,087	352	753	930	610
LG 전자	95,200	-1.24	35.1	44.3	77,570	252	0.09%	-1,237	139	1,097	315	813
호텔신라	81,900	0.24	10.8	43.7	15,863	-1,479	0.41%	-40	-1,789	1,828	232	1,596
셀트리온	354,500	0.57	136.7	42.4	54,360	3,397	-0.14%	339	3,314	-3,758	-4,733	0
한화솔루션	45,700	-3.59	52.9	40.2	87,358	-1,561	-0.37%	-5,012	178	4,843	16,457	7,534

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터