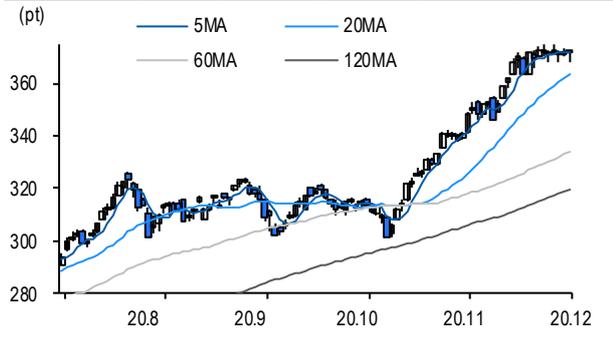
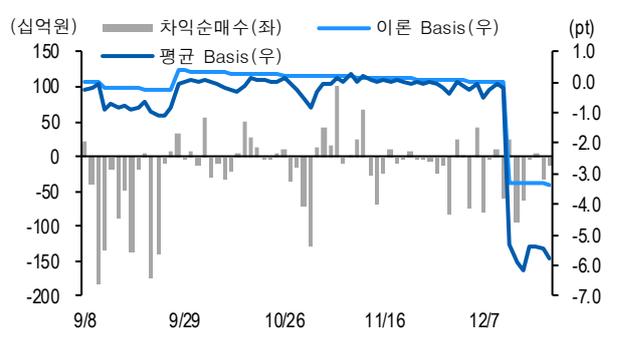


선물옵션시장 지표 2020.12.22

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	372.18	0.17	0.63	12,416.7	-
선물 12월물	366.35	0.01	0.05	24,033.5	228,341
선물 3월물	365.95	-0.07	-0.25	7.6	14,254
12월물(mini)	366.36	0.04	0.14	3,879.3	73,224
1월물(mini)	366.34	-0.04	-0.14	17.3	1,247

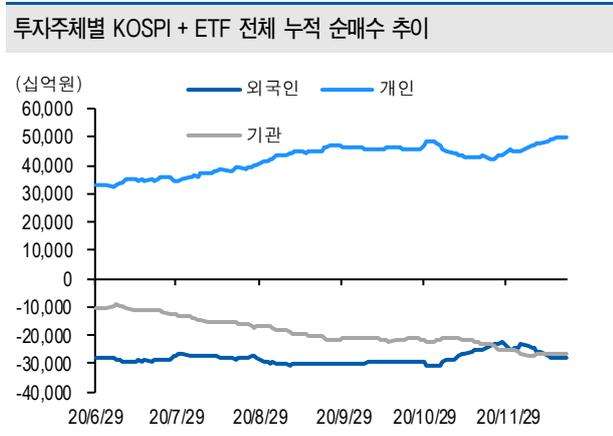


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-3.35	-5.78	-5.83	-0.65%
베이스(mini)	-2.30	-5.78	-5.82	-0.93%
제1스프레드(SP)	0.00	-0.31	-0.50	-0.08%
합성선물 베이스(ATM)	-2.30	-5.84	-5.84	-0.95%

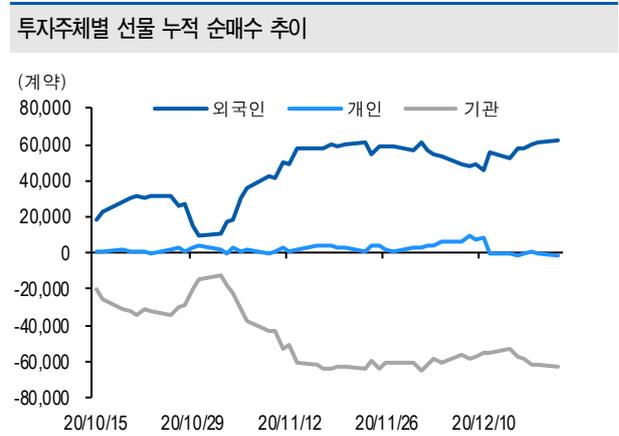


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-9.6	-15.2	-24.7	-8.6	60.6	77.1	8.5	-1.6	1.9	46.8
개인	-86.3	1.9	-84.4	0.0	0.3	-63.0	-17.9	1.5	-0.2	17.6
기관	132.0	15.6	147.5	-3.7	-2.1	-44.2	14.8	0.3	-1.6	-64.5
금융투자	51.6	-35.6	16.0	-3.7	-3.5	-52.9	15.0	0.4	-1.5	-10.3
투신	-8.2	26.0	17.8	0.0	-0.4	3.9	-0.2	-0.1	0.0	-21.4
은행+보험+기타금융	-20.2	29.4	9.2	0.0	-0.7	2.5	-0.1	0.0	-0.1	1.1
연기금+국가자재	91.4	0.4	91.7	0.0	-12.0	2.3	0.0	0.0	0.0	-33.9
기타법인	-36.1	-2.4	-38.4	0.0	-0.4	30.1	-5.3	-0.1	-0.1	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	699,408	225.6	570,651	15.6%	지수옵션 전체	1,472,484	499.6	1,652,237
Put	773,076	274.0	1,081,586	20.7%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	20.54%(+0.97%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	2.07	-0.04	79,522	13,171	950	15.9	Put	375.0(K+1)	11.90	-0.25	197	503	23	21.3
	377.5(K+2)	2.63	-0.06	47,136	7,296	131	15.7		372.5(K+0)	10.30	-0.25	89	1,097	3	21.1
	375.0(K+1)	3.29	-0.10	37,364	5,843	-337	15.4		370.0(K-1)	8.81	-0.14	2,775	2,950	512	20.9
	372.5(K+0)	4.14	-0.08	24,429	5,234	184	15.3		367.5(K-2)	7.46	-0.12	2,801	4,050	310	20.7
	370.0(K-1)	5.13	-0.07	13,724	8,462	15	15.2		365.0(K-3)	6.27	-0.13	7,030	7,658	1,137	20.6

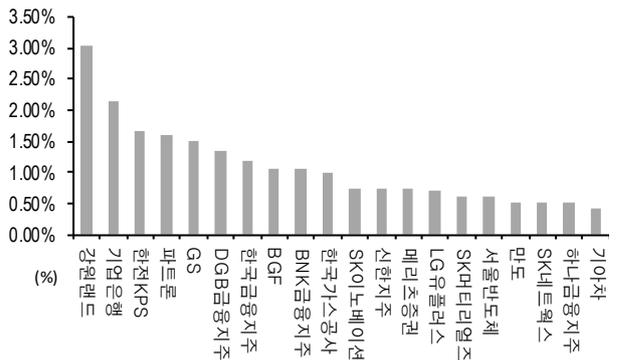
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,424,185	3,342.5	6,125,598	110,992	5,776	69,284	-81,988	46.8	17.6	-64.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	811,000	0.62	204.1	88.7	21,565	2,757	-0.62%	5,209	24	-5,200	-3,589	-1,679
한화솔루션	44,950	-1.64	85.9	78.3	43,966	-43,392	-0.83%	13,314	-56,546	43,193	36,111	2,777
삼성전자	71,600	-0.97	1,031.7	70.0	1,232,122	-19,687	-1.37%	9,027	-9,683	921	3,529	6,639
SK 하이닉스	115,000	-2.54	269.3	65.2	315,439	-20,369	0.19%	100	-8,238	8,552	8,405	4,643
SK 이노베이션	187,500	-0.79	51.7	54.0	73,129	-2,047	0.75%	704	-310	-155	1,579	-41
카카오	380,500	3.40	163.5	53.4	34,658	9,553	0.03%	2,072	6,813	-9,365	-4,604	-5,541
NAVER	284,500	0.53	65.1	48.8	30,423	5,981	0.19%	53	5,704	-5,754	-1,871	-3,883
현대차	184,000	-1.08	97.4	47.0	78,676	-1,939	-0.12%	-1,486	2,567	-743	269	1,255
현대모비스	246,500	0.00	27.1	46.2	12,437	-732	-0.17%	-164	-353	517	876	132
한국전력	27,400	-1.26	217.5	45.5	330,011	10,230	-2.13%	-14,542	3,337	9,949	8,524	-369

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터