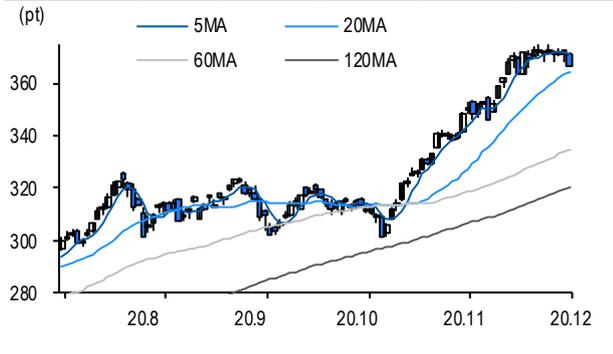


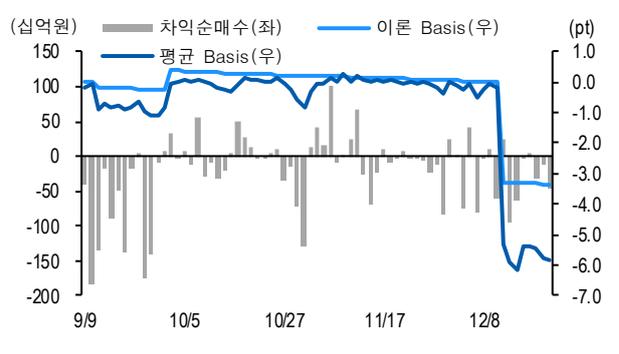


선물옵션시장 지표 2020.12.23

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	366.43	-1.54	-5.75	12,163.4	-
선물 12월물	360.75	-1.53	-5.60	29,258.1	226,235
선물 3월물	360.30	-1.54	-5.65	7.4	14,249
12월물(mini)	360.78	-1.52	-5.58	3,986.5	72,186
1월물(mini)	360.66	-1.55	-5.68	15.7	1,281

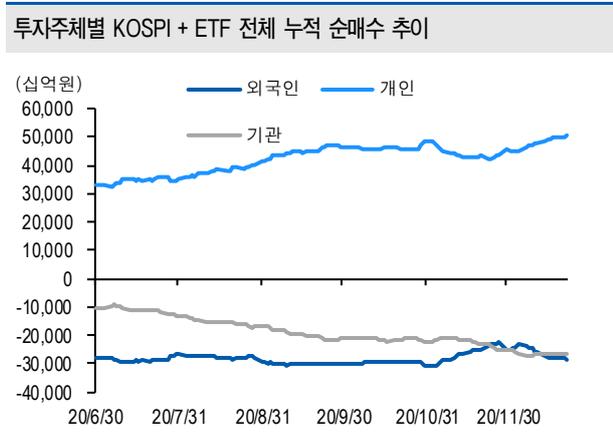


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	-3.37	-5.84	-5.68	-0.68%	
베이스(mini)	-2.27	-5.86	-5.65	-0.98%	
제1스프레드(SP)	-0.02	-0.42	-0.40	-0.11%	
합성선물 베이스(ATM)	-2.27	-5.60	-5.60	-0.91%	

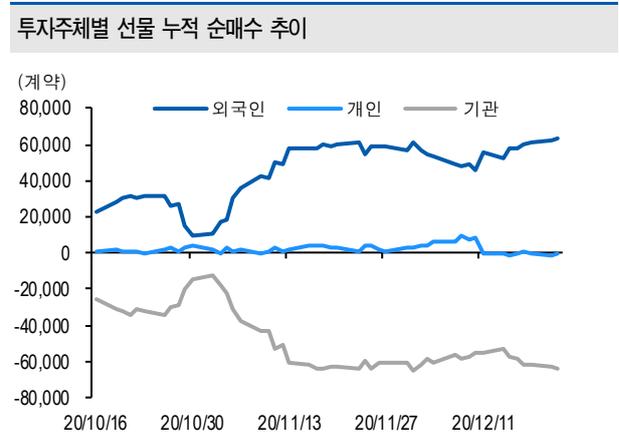


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-149.1	-102.9	-252.0	-5.3	-144.2	119.4	-93.4	-6.2	0.8	-7.2
개인	369.8	189.5	559.4	0.0	0.2	88.8	1.0	5.5	1.6	47.1
기관	-202.9	-77.2	-280.2	-40.8	-68.5	-202.9	86.2	1.7	-2.5	-39.0
금융투자	-52.5	-152.5	-204.9	-3.7	-9.0	73.4	86.5	1.8	-2.6	-28.7
투신	-52.0	-17.6	-69.6	0.0	-33.4	-339.4	-0.2	0.0	0.1	-7.1
은행+보험+기타금융	-36.3	87.8	51.4	0.0	-13.9	21.1	-0.1	0.0	0.0	-0.4
연기금+국가자재	-7.1	0.9	-6.1	-37.1	-5.6	42.0	0.0	0.0	0.0	-2.8
기타법인	-17.8	-9.4	-27.2	0.0	0.0	-5.4	6.3	-1.1	0.1	-0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	793,097	265.6	600,249	17.0%	지수옵션 전체	1,981,318	722.1	1,717,223
Put	1,188,221	456.5	1,116,974	22.0%	PCR(금액기준)	1.72	VKOSPI	22.85%(+2.31%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	1.21	-0.86	79,717	14,568	1,397	17.1	Put	375.0(K+1)	16.00	4.10	139	527	24	22.6
	377.5(K+2)	1.59	-1.04	61,088	9,153	1,857	17.1		372.5(K+0)	14.30	4.00	147	1,119	22	22.8
	375.0(K+1)	2.05	-1.24	55,944	8,270	2,427	16.9		370.0(K-1)	12.50	3.69	3,142	3,685	735	22.4
	372.5(K+0)	2.63	-1.51	38,287	6,247	1,013	16.9		367.5(K-2)	10.85	3.39	2,946	4,231	181	22.1
	370.0(K-1)	3.34	-1.79	21,328	9,931	1,469	16.9		365.0(K-3)	9.35	3.08	7,639	8,330	672	22.0

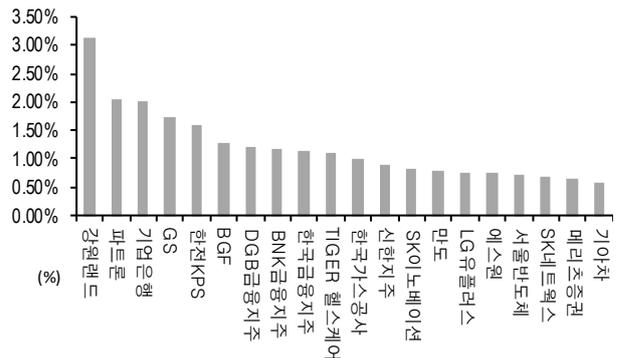
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,619,972	3,525.4	6,175,778	50,180	-46,719	88,060	-38,964	-7.2	47.1	-39.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	71,000	-0.84	1,074.2	90.9	1,260,255	28,133	-1.38%	13,699	5,161	-18,468	-17,837	-10,746
LG 화학	791,000	-2.47	164.2	66.9	20,861	-704	-0.58%	1,427	-146	-1,279	-1,015	-259
SK 하이닉스	112,500	-2.17	322.7	66.6	316,398	959	0.35%	3,305	-1,110	-2,194	-3,232	-853
한화솔루션	45,450	1.11	169.2	58.8	50,330	6,364	-0.04%	2,623	3,195	-6,041	-25,149	-7,240
SK 이노베이션	182,500	-2.67	71.4	58.4	69,751	-3,378	0.82%	-1,332	1,307	-353	174	2,564
카카오	377,000	-0.92	192.4	57.5	37,188	2,530	0.07%	-784	3,031	-2,537	-1,040	-1,672
LG 이노텍	164,500	-2.95	15.7	56.5	17,272	905	0.00%	-792	-809	1,601	448	-439
삼성전기	162,500	-3.56	43.8	56.1	36,484	-1,840	0.30%	356	-6,591	6,640	2,789	4,010
NAVER	286,000	0.53	117.3	54.2	34,695	4,272	0.18%	-1,716	5,573	-3,940	-3,558	-495
LG 생활건강	1,597,000	-1.54	15.8	53.9	837	66	0.00%	-11	1	10	-50	-13

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터