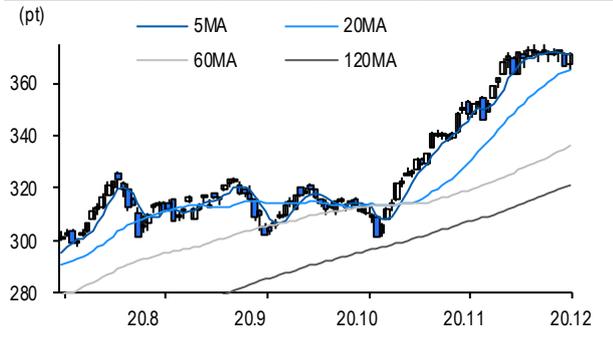


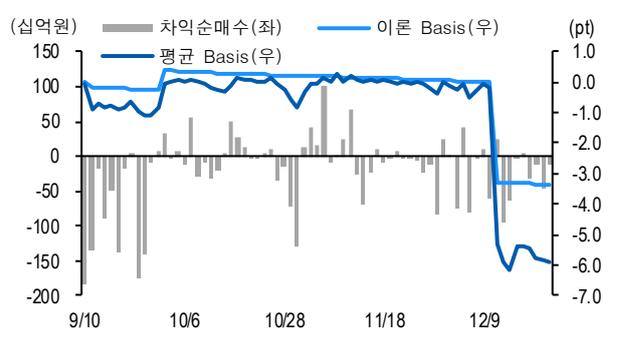


선물옵션시장 지표 2020.12.24

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	371.32	1.33	4.89	14,037.3	-
선물 12월물	365.65	1.36	4.90	27,480.4	229,163
선물 3월물	365.50	1.44	5.20	15.5	13,357
12월물(mini)	365.50	1.31	4.72	4,383.3	80,753
1월물(mini)	365.52	1.35	4.86	21.2	1,085

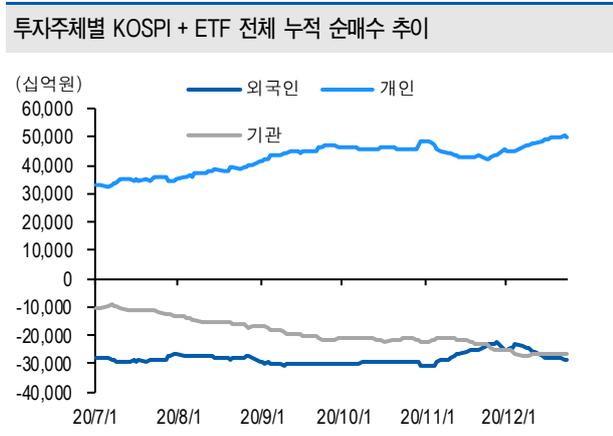


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-3.37	-5.89	-5.67	-0.68%
베이스스(mini)	-2.31	-5.99	-5.82	-0.99%
제1스프레드(SP)	-0.01	-0.31	-0.30	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	-2.31	-5.76	-5.76	-0.93%

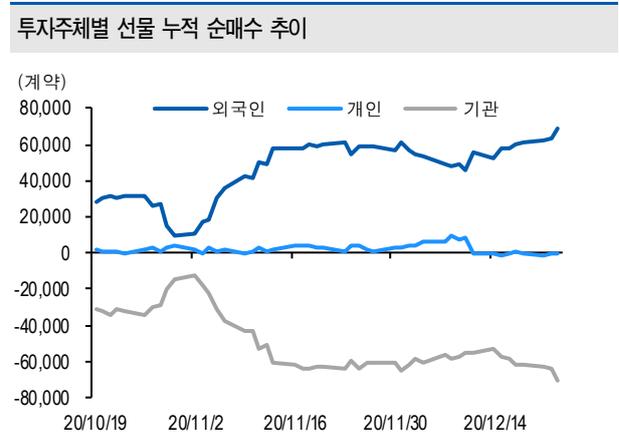


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	82.7	30.0	112.7	-9.0	92.6	317.6	239.9	-1.2	-0.2	6.6
개인	-384.5	-20.8	-405.3	0.0	-0.9	-30.7	6.2	-1.1	-1.3	55.3
기관	301.5	-2.5	299.1	-3.0	-130.2	-342.3	-242.8	1.4	1.0	-60.5
금융투자	386.6	58.8	445.4	-1.8	16.8	-504.8	-243.4	1.5	1.0	-107.1
투신	-39.0	4.5	-34.5	0.0	-39.4	212.2	0.7	-0.1	0.0	76.1
은행+보험+기타금융	-21.2	-21.7	-42.9	0.0	-14.2	-20.7	0.0	0.1	0.0	3.7
연기금+국가자재	35.0	-40.4	-5.4	-1.2	-38.8	-29.0	0.0	0.0	0.0	-33.1
기타법인	0.3	-6.7	-6.4	0.0	0.2	55.4	-3.3	0.8	0.5	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,009,012	353.9	603,682	15.3%	지수옵션 전체	2,177,519	749.3	1,750,480
Put	1,168,507	395.4	1,146,798	21.2%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	21.52%(-1.33%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	375.0(K+3)	2.75	0.70	83,882	7,979	-291	15.3	Put	370.0(K+1)	8.97	-3.53	630	3,696	11	20.9
	372.5(K+2)	3.55	0.92	55,922	6,389	142	15.3		367.5(K+0)	7.60	-3.25	3,928	4,710	479	20.8
	370.0(K+1)	4.54	1.20	37,923	9,441	-490	15.3		365.0(K-1)	6.42	-2.93	5,572	8,716	386	20.9
	367.5(K+0)	5.66	1.47	22,595	5,942	158	15.2		362.5(K-2)	5.39	-2.63	6,290	6,672	195	21.0
	365.0(K-1)	6.96	1.75	10,868	7,205	567	15.1		360.0(K-3)	4.54	-2.36	9,926	7,185	111	21.3

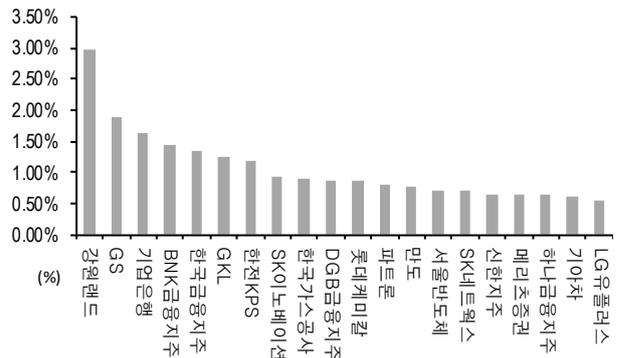
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,140,572	4,782.0	6,451,892	276,114	-18,017	39,510	-14,555	6.6	55.3	-60.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,900	2.68	1,207.5	85.2	1,340,958	80,703	-1.19%	384	65,717	-67,048	-49,818	-26,890
카카오	379,000	0.53	184.8	77.2	37,512	324	0.10%	-1,558	842	1,415	-197	189
LG 생활건강	1,602,000	0.31	21.6	74.6	935	98	0.05%	-43	1	42	-48	12
한화솔루션	46,800	2.97	89.0	73.2	52,015	1,685	0.05%	-1,105	-2,905	4,011	-3,787	-350
NAVER	284,500	-0.52	102.7	71.0	34,641	-54	0.13%	-294	-370	663	-713	1,373
LG 화학	801,000	1.26	235.4	64.2	22,418	1,557	-0.58%	1,706	714	-2,448	-2,260	-97
현대차	183,000	1.39	146.7	60.9	83,148	4,931	0.14%	2,882	-737	-2,439	-1,135	-3,962
SK 하이닉스	115,500	2.67	215.6	59.4	336,790	20,392	0.53%	3,700	16,040	-19,668	-23,656	-5,032
SK 이노베이션	181,000	-0.82	62.1	58.6	68,754	-997	0.93%	588	-688	105	606	-411
삼성전기	167,000	2.77	76.7	57.2	38,279	1,795	0.24%	1,366	1,605	-3,372	-2,712	-1,320

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터