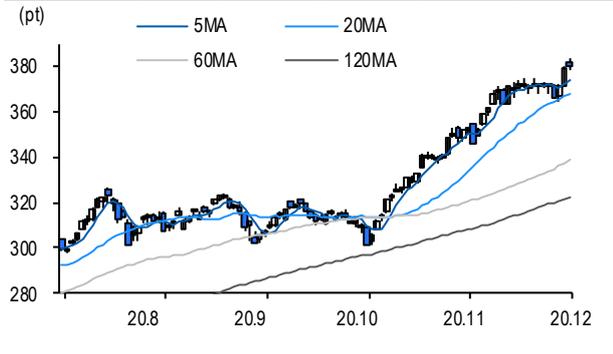


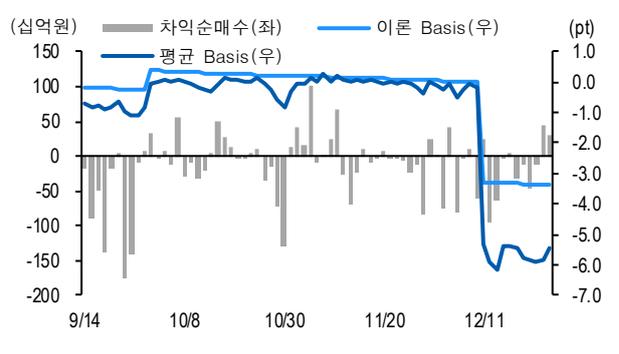


선물옵션시장 지표 2020.12.29

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	379.93	0.20	0.75	18,207.1	-
선물 12월물	376.15	0.55	2.05	28,450.5	236,695
선물 3월물	375.85	0.60	2.25	13.5	13,385
12월물(mini)	375.90	0.71	2.64	5,551.8	154,665
1월물(mini)	376.04	0.60	2.24	159.1	6,594

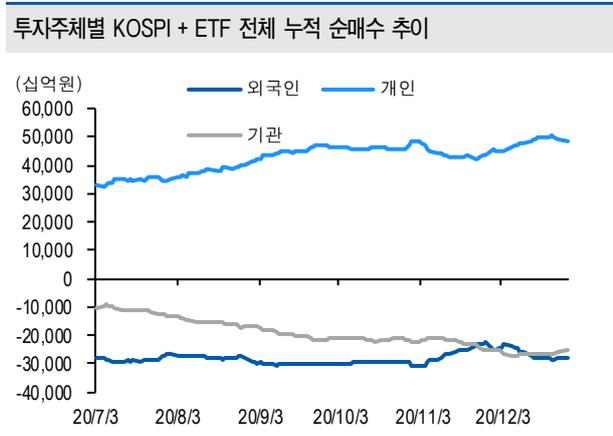


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	-3.39	-5.47	-3.78	-0.55%	
베이스(mini)	-2.40	-5.59	-4.03	-0.84%	
제1스프레드(SP)	0.01	-0.39	-0.25	-0.11%	
합성선물 베이스(ATM)	-2.40	-4.05	-4.05	-0.43%	

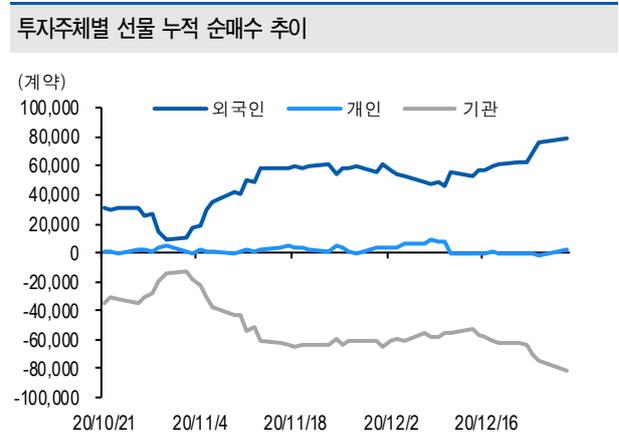


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	78.0	-56.2	21.8	0.0	-27.0	-578.5	857.1	-10.0	4.2	107.5
개인	-946.0	160.7	-785.3	0.0	-34.4	300.7	18.8	7.6	-2.1	108.3
기관	830.3	-107.3	723.0	29.3	-116.2	230.7	-876.5	1.9	-1.3	-220.9
금융투자	1,095.7	-0.7	1,095.0	28.3	1.4	105.7	-876.7	2.2	-1.3	-299.6
투신	-96.4	-44.4	-140.9	0.0	-57.9	117.7	0.2	-0.3	0.0	61.5
은행+보험+기타금융	-89.0	-60.7	-149.7	-1.0	-44.8	5.3	0.0	0.0	0.0	-4.5
연기금+국가자재	-76.2	-19.4	-95.6	2.0	-0.6	2.1	-0.1	0.0	0.0	21.8
기타법인	37.7	2.8	40.5	0.0	1.2	47.1	0.6	0.5	-0.8	5.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

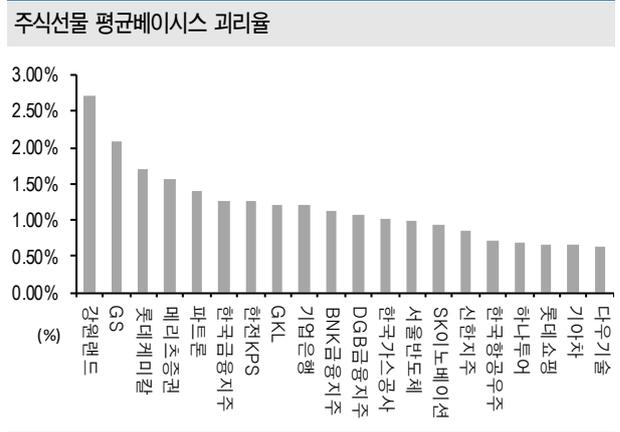
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,161,152	478.8	659,398	20.2%	지수옵션 전체	2,600,870	948.5	1,974,799
Put	1,439,718	469.7	1,315,401	21.4%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	23.14%(+1.61%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	387.5(K+3)	2.65	0.72	65,440	13,898	1,063	20.3	Put	382.5(K+1)	10.70	-2.10	439	337	203	21.2
	385.0(K+2)	3.30	0.80	59,799	22,499	-313	20.2		380.0(K+0)	9.13	-1.62	7,008	3,083	2,475	21.1
	382.5(K+1)	4.08	0.93	32,393	16,299	1,633	20.1		377.5(K-1)	7.69	-1.46	10,327	4,751	4,373	21.1
	380.0(K+0)	5.01	1.07	27,623	16,406	-42	20.1		375.0(K-2)	6.47	-0.63	15,343	6,223	4,972	21.2
	377.5(K-1)	6.09	1.17	18,579	12,447	2,506	20.1		372.5(K-3)	5.44	-0.49	15,711	6,814	1,451	21.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	5,900,184	5,429.3	6,799,126	154,041	148,633	116,167	-269,892	107.5	108.3	-220.9		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한화솔루션	44,750	-1.86	78.0	65.6	64,026	9,129	-0.04%	190	8,306	-8,496	-16,486	5,490
현대모비스	245,500	-1.41	52.3	63.0	9,544	-6,864	-0.24%	687	352	-1,043	3,853	2,018
LG 화학	806,000	-0.37	134.4	62.3	22,877	-477	-0.59%	116	230	-375	-1,861	1,616
SK 하이닉스	116,000	-0.85	343.5	60.6	375,571	10,262	0.54%	-1,226	2,673	-1,603	-11,412	865
기아차	62,200	1.80	78.5	54.9	142,213	23,574	0.66%	1,797	-474	-1,321	-5,918	-15,126
삼성전자	77,500	0.91	1,701.5	53.6	1,401,694	-37,209	-1.31%	100,168	-34,449	-65,624	11,738	24,104
카카오	374,500	0.00	123.4	51.2	40,001	4,253	0.17%	2,332	-4,277	1,945	-696	-4,843
LG 이노텍	180,000	3.15	70.7	50.3	15,029	-2,844	-0.51%	3,732	-147	-3,578	-617	322
LG 디스플레이	18,050	1.40	80.8	46.1	486,645	-28,453	-0.59%	47,296	-1,856	-46,616	-8,789	-11,702
한온시스템	15,800	-1.25	7.3	42.6	19,279	-22,172	-0.58%	2,769	-1,397	-1,372	11,550	8,100

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터