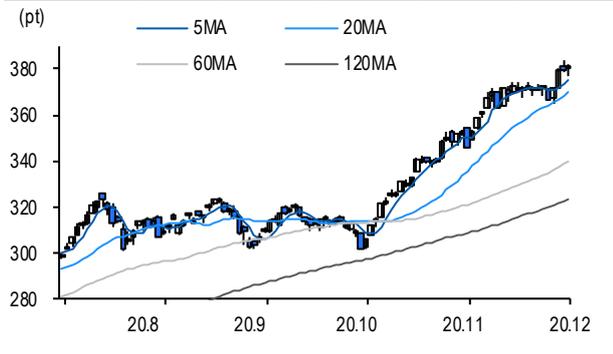


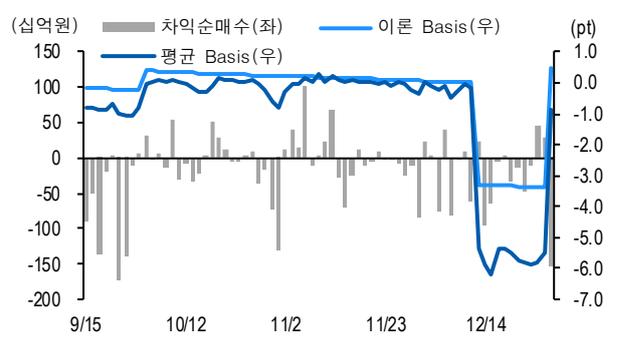


선물옵션시장 지표 2020.12.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	381.27	0.35	1.34	14,461.1	-
선물 3월물	380.95	1.28	4.80	30,595.4	230,260
선물 6월물	380.50	1.24	4.65	15.0	13,388
1월물(mini)	380.88	1.32	4.98	4,124.8	115,942
2월물(mini)	381.22	1.38	5.18	43.0	7,060

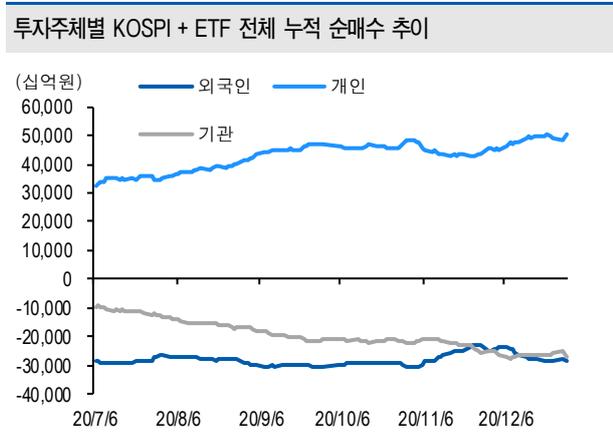


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.50	-0.84	-0.32	-0.35%
베이스(mini)	0.11	-0.81	-0.39	-0.24%
제1스프레드(SP)	0.02	-0.33	-0.45	-0.09%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	-0.40	-0.40	-0.13%

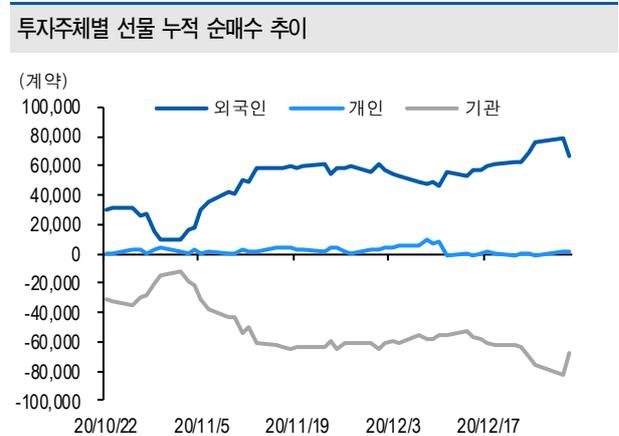


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-313.7	63.0	-250.7	-1.9	-113.1	-373.1	-826.4	26.1	-2.1	-27.6
개인	2,198.1	-141.7	2,056.4	0.0	24.8	-28.8	-34.5	-30.3	1.1	-117.6
기관	-1,972.1	83.7	-1,888.5	-151.3	-253.2	558.8	857.4	1.9	0.8	149.7
금융투자	-1,432.6	185.6	-1,247.0	-151.0	-51.7	388.4	856.6	1.5	0.8	224.1
투신	-147.7	16.2	-131.5	0.0	-94.2	136.0	0.8	0.4	0.0	-49.1
은행+보험+기타금융	-108.0	-157.6	-265.6	-4.3	-21.9	24.0	0.0	0.0	0.0	8.3
연기금+국가자재	-195.8	4.8	-191.0	3.9	-37.3	10.5	-0.1	0.0	0.0	-33.6
기타법인	87.7	-4.9	82.8	0.0	-1.7	-157.0	3.5	2.3	0.2	-4.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,471,626	593.4	659,131	17.9%	지수옵션 전체	2,786,927	985.7	2,014,797
Put	1,315,301	392.3	1,355,666	20.0%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	21.63%(-1.51%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	387.5(K+3)	3.41	0.76	73,675	13,453	-445	18.1	Put	382.5(K+1)	6.90	-3.80	3,714	2,160	1,823	19.3
	385.0(K+2)	4.25	0.95	51,456	21,232	-1,267	17.8		380.0(K+0)	5.66	-3.47	16,988	6,501	3,418	19.3
	382.5(K+1)	5.29	1.21	40,035	11,475	-4,824	17.7		377.5(K-1)	4.61	-3.08	15,886	6,253	1,502	19.5
	380.0(K+0)	6.53	1.52	28,725	14,087	-2,319	17.7		375.0(K-2)	3.74	-2.73	17,050	6,187	-36	19.8
	377.5(K-1)	8.00	1.91	12,997	10,083	-2,364	17.9		372.5(K-3)	3.04	-2.40	23,685	6,182	-632	20.2

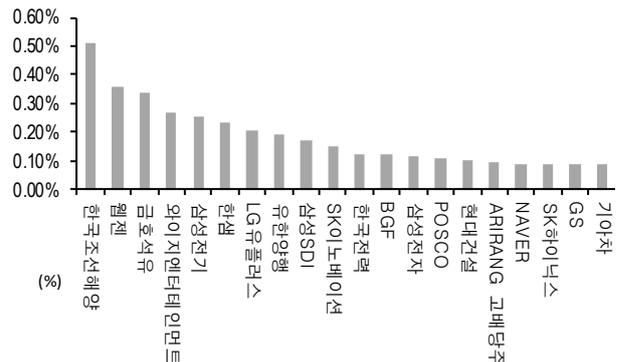
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,119,108	5,149.8	6,749,470	-49,656	-63,982	-50,236	113,569	-27.6	-117.6	149.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	812,000	0.74	227.3	71.2	21,305	-1,572	-0.01%	223	239	-461	1,491	-560
삼성전자	78,700	1.55	1,624.6	68.7	1,394,970	-6,724	0.12%	-12,993	-26,026	39,333	35,701	-34,637
기아차	62,700	0.80	73.1	63.8	145,768	3,555	0.09%	-6,304	653	5,662	-3,430	5,923
SK 하이닉스	116,000	0.00	305.9	62.6	358,443	-17,128	0.09%	790	-9,657	8,809	9,004	8,895
SK 이노베이션	183,000	2.23	93.3	58.8	67,697	-1,322	0.15%	2,327	612	-1,073	-2,023	596
엔씨소프트	913,000	2.70	65.3	51.3	3,887	-6	0.00%	18	-237	200	5	127
현대모비스	251,000	2.24	39.6	49.5	10,516	972	0.05%	304	-200	-108	-788	-908
현대차	191,000	1.60	136.9	48.5	95,536	-4,165	0.02%	-7,001	-5,354	12,369	9,976	1,749
한국금융지주	79,200	1.02	20.1	47.7	47,168	-164	0.06%	-1,190	-241	1,421	1,755	-562
삼성전기	177,500	5.65	96.0	47.4	54,457	10,882	0.25%	769	6,128	-6,894	-736	-9,528

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터