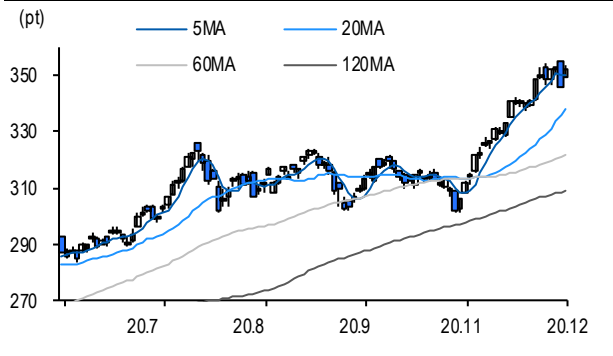
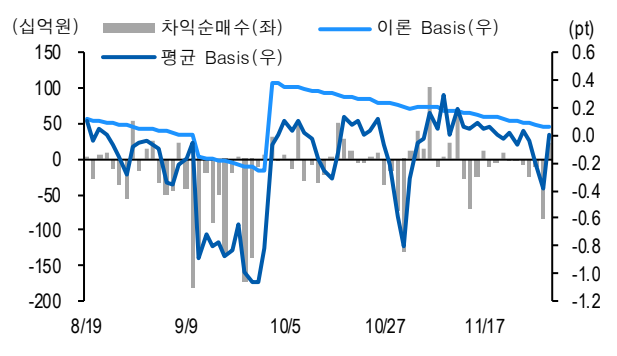


선물옵션시장 지표 2020.12.2

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	352.40	1.83	6.35	9,719.4	-	
선물 12월물	352.40	1.48	5.15	22,927.4	272,777	
선물 3월물	347.75	1.53	5.25	177.8	22,462	
12월물(mini)	352.38	1.47	5.16	2,277.2	171,174	
1월물(mini)	347.48	1.37	4.68	52.0	17,806	

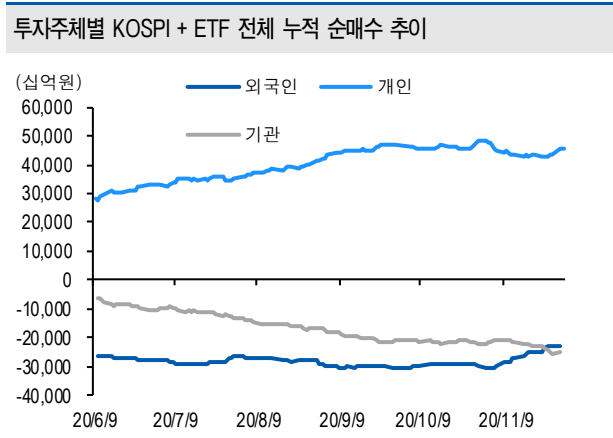


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.06	0.00	0.00	-0.02%	
베이스스(mini)	0.06	0.00	-0.02	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-3.35	-4.61	-4.60	-0.36%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.06	-0.05	-0.05	-0.03%	

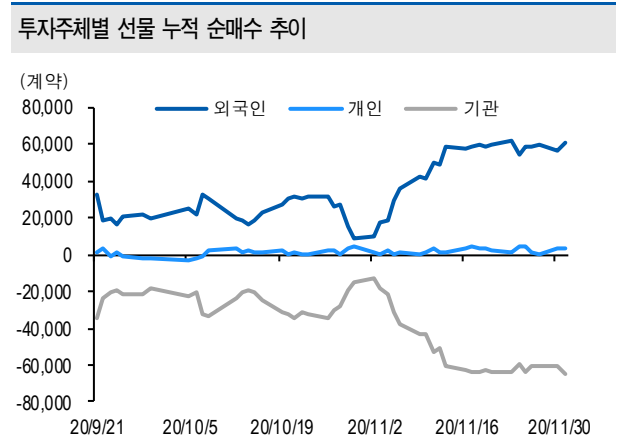


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	71.3	23.8	95.1	10.5	-25.6	153.3	267.8	-11.4	3.4	7.9	
개인	-342.9	-38.9	-381.8	0.0	5.6	27.8	-6.5	5.6	-1.0	4.4	
기관	267.4	4.3	271.7	13.8	-177.9	-129.0	-240.5	4.8	-2.4	-11.6	
금융투자	329.8	22.3	352.1	0.0	-8.3	-315.2	-240.5	4.5	-2.6	-18.5	
투신	-9.8	-9.5	-19.4	0.0	-30.5	249.9	0.0	0.3	0.2	32.8	
은행+보험+기타금융	-35.7	9.0	-26.7	0.0	-33.7	-49.6	0.1	0.0	0.0	0.9	
연기금+국가자재	-13.2	-0.7	-13.9	13.8	-101.6	-14.1	-0.1	0.0	0.0	-26.8	
기타법인	4.2	10.8	15.0	0.0	0.5	-52.1	-20.8	1.0	0.0	-0.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,041,552	319.6	822,555	18.1%	지수옵션 전체	1,848,734	508.9	2,552,660
Put	807,182	189.3	1,730,105	21.6%	PCR(금액기준)	0.59	VKOSPI	20.21%(-0.56%p)

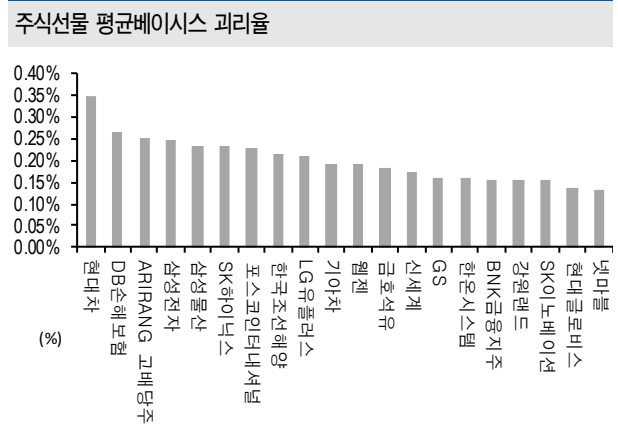
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	4.23	1.89	46,423	12,256	1,321	18.3	Put	347.5(K+1)	2.49	-2.31	25,959	11,006	469	19.7
	350.0(K+2)	5.64	2.24	24,390	23,460	1,199	18.5		345.0(K+0)	1.85	-1.70	49,999	12,037	1,275	20.2
	347.5(K+1)	7.33	2.84	7,286	13,099	593	19.1		342.5(K-1)	1.39	-1.34	57,143	12,012	1,878	21.0
	345.0(K+0)	9.20	3.59	3,268	12,756	321	19.6		340.0(K-2)	1.06	-1.11	80,952	22,165	3,656	21.9
	342.5(K-1)	11.00	3.44	302	9,143	-95	18.8		337.5(K-3)	0.81	-0.96	60,036	14,453	753	22.8

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	4,265,382	3,212.7	6,661,416	70,692	12,125	-8,346	-5,606	7.9	4.4	-11.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	810,000	1.76	235.6	72.7	29,733	-347	0.00%	-376	361	8	-241	773
삼성전자	68,100	1.49	1,077.0	72.7	1,434,606	54,775	0.25%	-10,279	16,535	-5,423	-8,561	-30,250
롯데케미칼	285,500	0.18	25.0	63.7	13,727	-605	0.04%	390	-161	-64	98	551
기아차	59,900	2.74	67.5	63.7	227,713	29,151	0.19%	-3,668	-1,415	5,049	-19,268	-1,680
삼성전기	162,500	3.50	72.0	54.5	40,036	-769	0.06%	807	-1,186	61	-1,009	470
현대차	184,500	1.10	163.7	50.2	97,321	676	0.35%	-2,073	216	1,875	-1,157	735
한국전력	21,700	1.40	30.5	49.9	260,906	-76,447	0.11%	1,955	-3,018	2,726	-38,838	42,056
KB 금융	46,050	0.66	53.5	48.6	78,197	14,560	0.07%	-1,613	10,222	-11,609	-2,958	-11,505
카카오	375,000	2.04	81.5	48.5	33,265	3,216	0.07%	1,104	1,131	-2,250	40	-3,165
하나금융지주	34,700	1.76	21.5	47.0	96,590	-5,049	0.07%	-4,415	1,304	2,811	95	2,767

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터