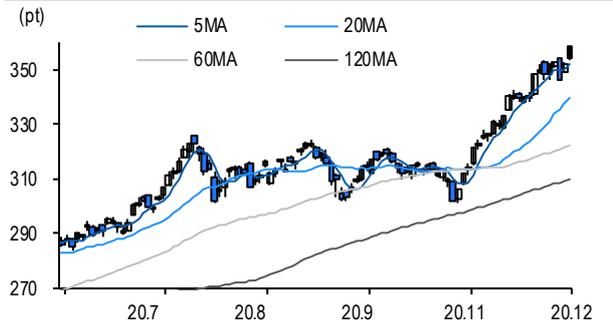


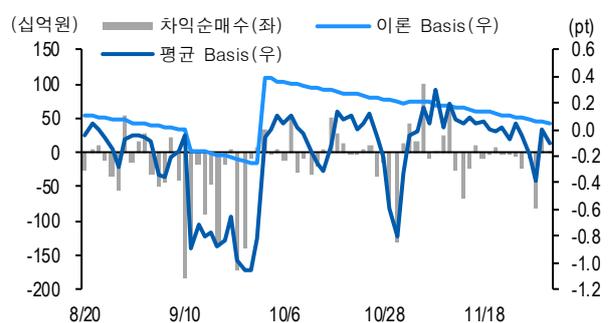


선물옵션시장 지표 2020.12.3

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	358.66	1.78	6.26	9,874.1	-	
선물 12월물	358.75	1.80	6.35	29,126.3	268,747	
선물 3월물	354.05	1.81	6.30	266.4	25,575	
12월물(mini)	358.72	1.79	6.34	3,884.1	182,733	
1월물(mini)	353.84	1.83	6.36	68.8	19,949	

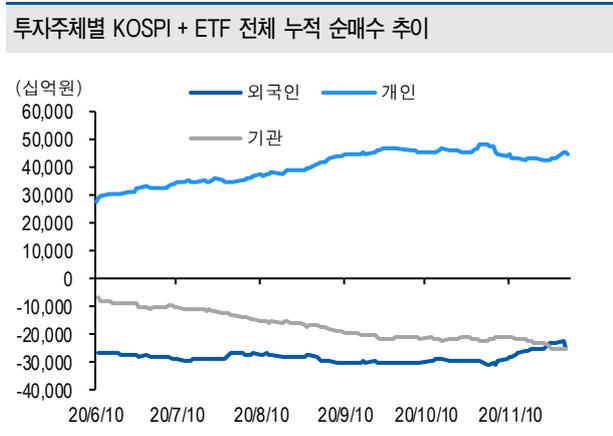


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.05	-0.11	0.09	-0.05%	
베이스스(mini)	0.05	-0.11	0.06	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-3.35	-4.59	-4.55	-0.35%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	0.06	0.06	0.00%	

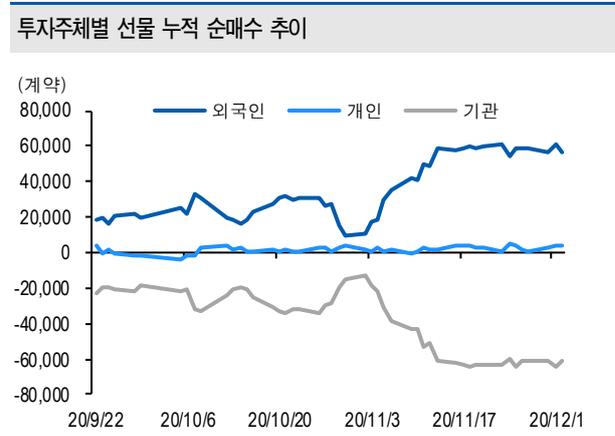


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	516.3	21.3	537.6	2.2	245.8	-274.5	-119.5	3.8	-1.1	-25.9	
개인	-245.1	22.7	-222.4	0.0	-0.8	65.7	-27.9	-5.0	-0.1	67.6	
기관	-248.7	-49.0	-297.6	0.4	-107.3	167.9	144.8	0.7	1.6	-45.3	
금융투자	-162.7	138.9	-23.8	-3.5	1.1	-55.0	144.1	-0.6	2.6	-60.1	
투신	-11.3	-17.1	-28.3	0.0	-27.8	208.3	0.7	0.8	0.0	12.5	
은행+보험+기타금융	-18.6	-178.0	-196.6	0.0	-16.5	15.8	0.0	0.4	-1.0	-1.3	
연기금+국가지자체	-36.5	-5.9	-42.3	4.0	-39.9	-1.2	0.0	0.0	0.0	3.5	
기타법인	-22.5	4.9	-17.6	0.0	0.1	40.9	2.5	0.5	-0.4	3.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성	지수옵션 전체	거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,588,334	557.3	805,631	18.5%				
Put	1,127,052	242.1	1,804,924	21.2%	PCR(금액기준)	0.43	VKOSPI	20.18%(-0.03%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	3.53	2.08	146,630	19,164	-3,885	18.4	Put	355.0(K+1)	2.66	-3.06	37,014	5,949	3,173	19.1
	357.5(K+2)	4.82	2.70	64,343	10,418	-2,058	18.6		352.5(K+0)	1.96	-2.42	52,294	9,319	3,324	19.7
	355.0(K+1)	6.36	3.32	23,357	13,360	-1,811	19.0		350.0(K-1)	1.45	-1.88	79,828	18,272	3,747	20.4
	352.5(K+0)	8.18	3.95	9,525	9,587	-2,669	19.7		347.5(K-2)	1.07	-1.42	85,500	13,912	2,906	21.2
	350.0(K-1)	10.20	4.56	15,245	23,550	90	20.6		345.0(K-3)	0.81	-1.04	106,355	20,716	8,679	22.2

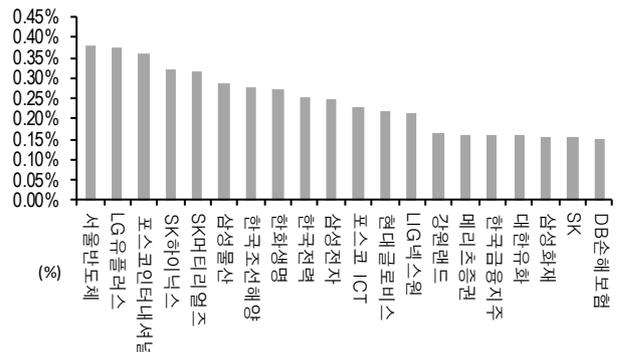
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,469,180	3,678.2	6,902,611	241,195	-10,320	125,553	-118,353	-25.9	67.6	-45.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	69,800	2.50	1,413.6	73.2	1,484,434	49,828	0.25%	6,254	72,686	-86,363	-71,257	-2,513
삼성전기	162,500	0.00	107.3	64.3	43,722	3,686	0.10%	-2,571	101	2,820	985	-1,367
LG 화학	842,000	3.95	268.4	55.9	30,090	357	0.03%	-504	13	432	834	-394
KB 금융	46,900	1.85	43.0	53.5	68,441	-9,756	0.02%	1,238	-3,403	5,357	-1,287	8,992
롯데케미칼	287,000	0.53	26.7	50.6	14,602	875	0.15%	-134	574	-450	-249	-848
하나금융지주	35,550	2.45	27.0	50.3	100,089	3,499	0.09%	7,089	-1,858	-4,456	-3,446	-5,029
SK 이노베이션	183,000	0.00	94.4	49.3	80,408	-3,667	0.14%	-983	-1,650	2,468	2,473	2,337
카카오	372,500	-0.67	75.9	48.5	32,675	-590	0.07%	-1,988	-229	2,237	427	1,538
SK 하이닉스	109,000	7.39	369.8	47.3	302,365	17,227	0.32%	908	1,547	-2,504	-15,892	-3,428
기아차	61,000	1.84	78.7	45.5	232,550	4,837	0.06%	-4,523	1,050	3,359	-7,744	9,958

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터