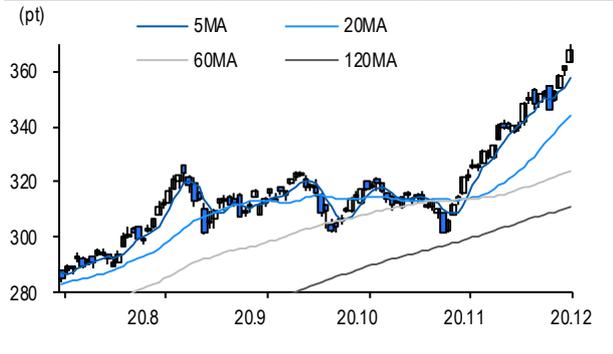


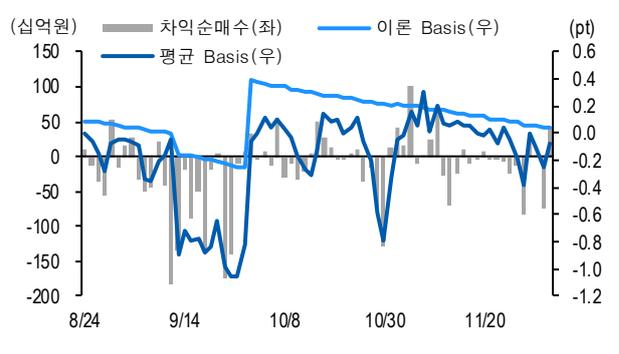


선물옵션시장 지표 2020.12.7

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	367.63	1.65	5.97	13,986.3	-
선물 12월물	368.10	1.88	6.80	39,064.0	266,308
선물 3월물	363.95	1.99	7.10	955.8	36,712
12월물(mini)	368.10	1.88	6.72	3,778.3	181,027
1월물(mini)	363.66	1.87	6.66	140.1	29,423

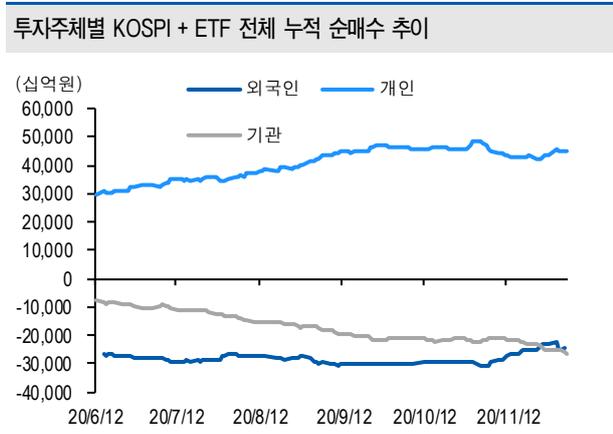


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.04	-0.07	0.47	-0.03%
베이스스(mini)	0.04	-0.07	0.47	-0.03%
제1스프레드(SP)	-3.34	-4.37	-4.35	-0.28%
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	0.43	0.43	0.11%

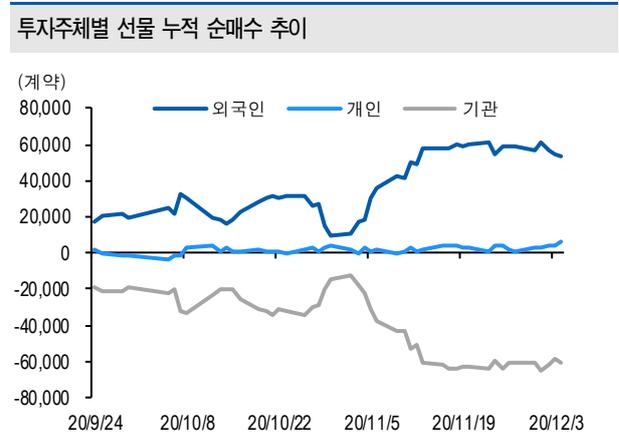


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	761.0	84.5	845.5	0.0	496.1	-233.5	97.9	-17.8	0.6	-8.6
개인	-343.2	87.1	-256.1	0.0	-2.4	221.0	18.1	11.6	-0.2	-24.7
기관	-410.1	-172.2	-582.3	40.5	-397.2	-7.7	-117.0	3.9	0.0	31.0
금융투자	36.5	106.4	142.9	-7.3	-7.4	-155.7	-117.5	2.9	-0.1	53.7
투신	-62.4	-81.4	-143.8	0.0	-33.3	215.4	0.5	0.5	0.1	-88.0
은행+보험+기타금융	-111.2	-202.5	-313.7	0.0	-79.6	-23.9	0.0	0.5	0.0	0.3
연기금+국가자재	-232.6	-5.5	-238.1	47.8	-242.7	-43.6	0.0	0.0	0.0	65.0
기타법인	-7.7	0.6	-7.1	0.0	3.0	20.2	1.0	2.3	-0.4	2.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

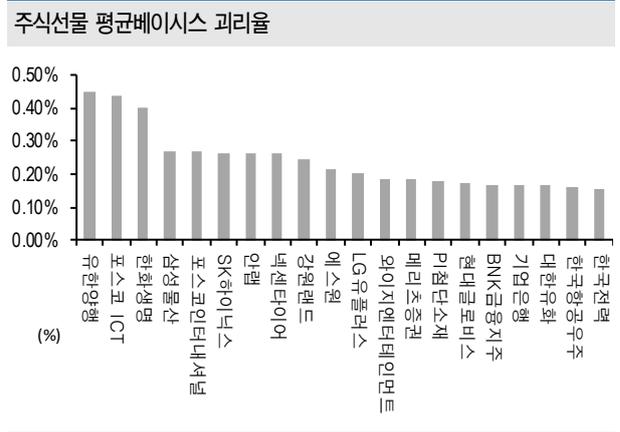
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,983,188	929.8	896,876	18.6%	지수옵션 전체	4,912,792	1,357.1	2,871,102
Put	1,929,604	427.3	1,974,226	18.6%	PCR(금액기준)	0.46	VKOSPI	21.01%(+0.99%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	2.70	1.78	210,095	17,574	-2,757	18.4	Put	365.0(K+1)	2.27	-3.58	91,191	6,867	6,273	17.0
	367.5(K+2)	3.80	2.38	120,068	13,358	-2,026	18.3		362.5(K+0)	1.54	-2.78	141,993	7,515	6,455	17.6
	365.0(K+1)	5.22	3.06	51,652	12,287	-3,412	18.4		360.0(K-1)	1.00	-2.10	200,209	14,703	10,383	18.0
	362.5(K+0)	7.10	3.99	23,885	11,568	-3,490	19.8		357.5(K-2)	0.66	-1.59	171,008	15,010	8,574	18.7
	360.0(K-1)	9.09	4.69	13,504	14,696	-3,188	20.8		355.0(K-3)	0.45	-1.08	185,008	19,241	9,377	19.6

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	5,612,726	5,229.8	6,928,815	-95,657	-28,006	2,134	23,676	-8.6	-24.7	31.0		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,000	3.15	1,507.5	75.0	1,303,685	-82,314	0.06%	6,599	-25,406	18,989	28,089	24,572
기아차	65,600	0.92	174.8	69.0	180,833	-46,907	0.03%	21,139	-2,334	-18,723	-5,362	19,012
LG 화학	842,000	-0.71	214.4	67.0	28,137	-1,647	-0.36%	-1,758	62	1,667	2,801	1,097
현대차	196,500	-0.25	374.6	58.9	100,017	-24,222	0.06%	-2,656	-8,247	11,258	12,122	5,417
KB 금융	47,300	0.32	45.9	55.7	62,536	-2,860	0.08%	5,561	-8,684	3,768	86	-3,537
SK 하이닉스	117,000	4.46	506.6	52.9	286,431	-19,787	0.27%	4,121	1,749	-6,578	-2,033	8,826
하나금융지주	36,550	1.81	33.6	51.6	75,557	-2,135	0.06%	-2,032	-2,941	7,324	-1,599	4,193
삼성전기	162,500	-0.31	50.1	45.1	36,605	-3,581	0.06%	409	-154	119	-2,006	3,168
LG 전자	90,800	0.55	71.0	44.6	63,965	-239	-0.10%	-214	3,604	-3,392	-3,471	-741
SK 이노베이션	179,000	-0.83	85.2	43.7	67,389	-8,272	0.03%	-928	-1,146	2,199	1,185	6,867

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터