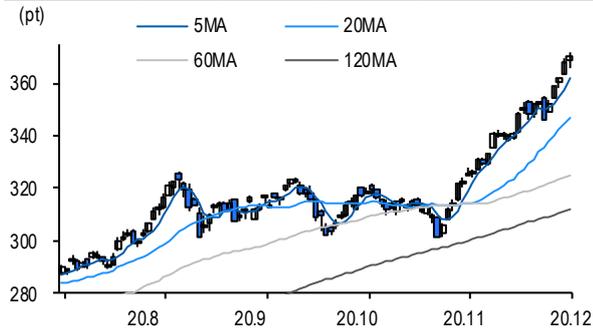


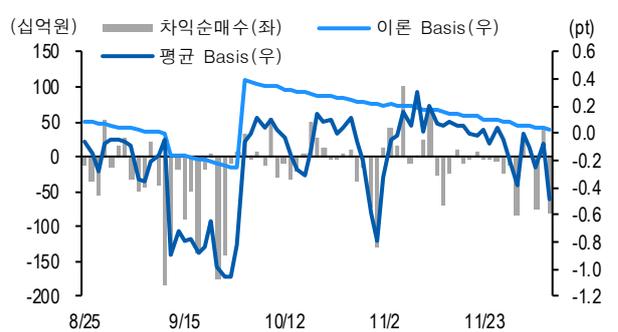
선물옵션시장 지표

2020.12.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	369.86	0.61	2.23	12,344.4	-
선물 12월물	369.85	0.48	1.75	35,828.5	229,914
선물 3월물	365.40	0.40	1.45	1,249.8	69,478
12월물(mini)	369.72	0.44	1.62	3,060.3	197,519
1월물(mini)	365.72	0.57	2.06	51.8	29,623



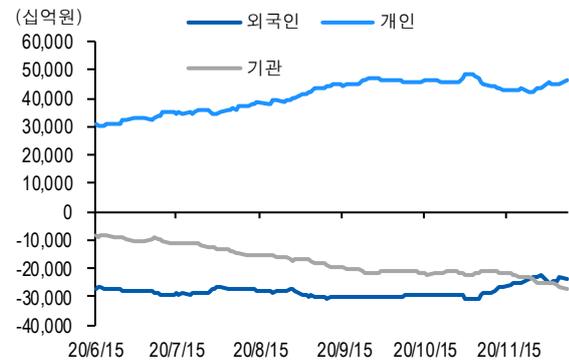
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.02	-0.49	-0.01	-0.14%
베이스(mini)	0.02	-0.49	-0.14	-0.14%
제1스프레드(SP)	-3.33	-4.43	-4.75	-0.30%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.07	-0.07	-0.02%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	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

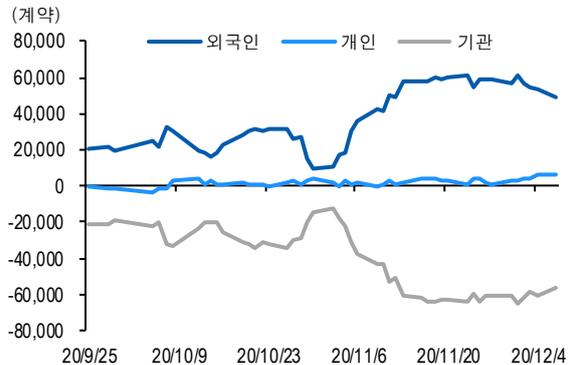
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	2,089,887	477.9	943,329	20.4%	지수옵션 전체	4,211,615	922.2	2,989,670		
Put	2,121,728	444.4	2,046,341	21.8%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	21.30%(+0.29%p)		

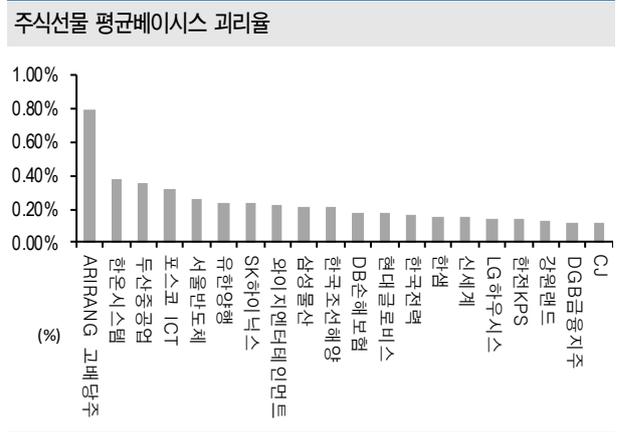
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	375.0(K+3)	1.26	0.02	235,158	18,373	-124	20.5	Put	370.0(K+1)	3.23	-1.41	24,997	3,639	1,255	20.5
	372.5(K+2)	2.00	0.15	182,522	18,159	2,942	20.2		367.5(K+0)	2.11	-1.19	98,911	6,685	3,243	20.5
	370.0(K+1)	3.02	0.32	122,121	16,836	-738	19.9		365.0(K-1)	1.34	-0.93	166,765	10,722	3,855	20.9
	367.5(K+0)	4.40	0.60	68,996	14,804	1,446	19.9		362.5(K-2)	0.82	-0.72	226,586	12,329	4,814	21.4
	365.0(K-1)	6.14	0.92	20,314	11,834	-453	20.2		360.0(K-3)	0.52	-0.48	313,872	18,665	3,962	22.3

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	5,865,823	5,265.2	6,859,114	-69,701	-16,580	-14,172	33,382	3.0	-26.1	23.8			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,900	1.25	1,760.0	85.7	1,225,016	-78,669	0.06%	-5,264	717	4,314	23,871	-9,537
카카오	382,500	-2.05	239.9	69.6	39,273	-4,704	0.06%	-1,122	-534	1,786	-313	3,469
SK 하이닉스	118,000	0.85	380.7	62.3	292,238	5,807	0.23%	1,371	-4,243	2,013	-10,151	378
기아차	64,600	-1.52	124.3	57.5	160,729	-20,104	0.02%	-2,854	-3,129	6,010	10,990	144
한국금융지주	79,500	-1.61	25.4	54.2	34,776	-1,731	0.06%	-3,067	1,213	1,846	215	1,618
현대차	194,000	-1.27	260.9	53.7	69,466	-30,551	0.00%	-893	1,073	-21	1,294	4,617
LG 전자	89,100	-1.87	58.9	51.2	61,554	-2,411	-0.04%	-2,948	1,232	1,688	-523	750
한화솔루션	46,850	3.77	89.4	46.9	91,747	1,354	0.06%	4,168	1,393	-5,731	-7,111	-7,725
NAVER	287,000	-2.55	110.9	46.3	27,591	-1,674	0.03%	540	125	-667	-351	-501
LG 화학	808,000	-4.04	188.1	46.2	27,852	-285	-0.52%	585	-708	127	-212	794

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터