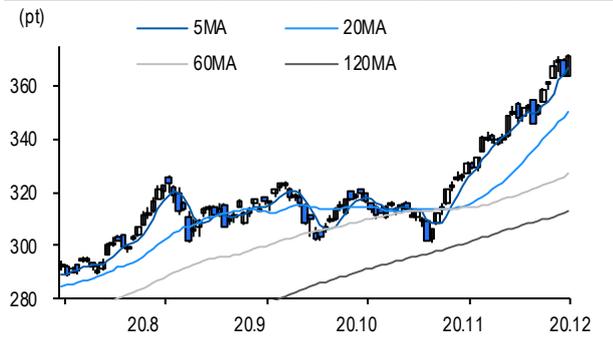


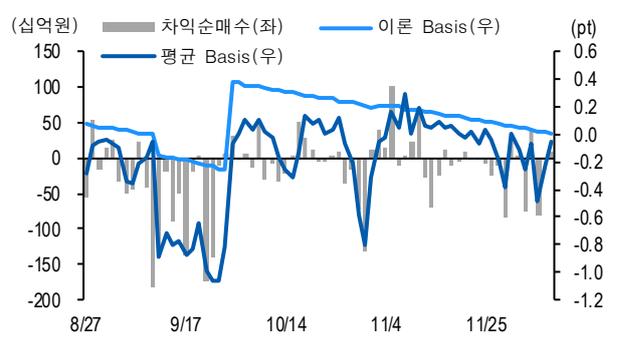


선물옵션시장 지표 2020.12.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	371.47	2.21	8.02	10,915.0	-
선물 12월물	371.25	2.15	7.80	31,692.2	125,025
선물 3월물	366.25	2.18	7.80	4,393.4	181,531
12월물(mini)	371.18	2.12	7.76	3,924.9	188,422
1월물(mini)	366.72	2.29	8.22	178.0	29,775

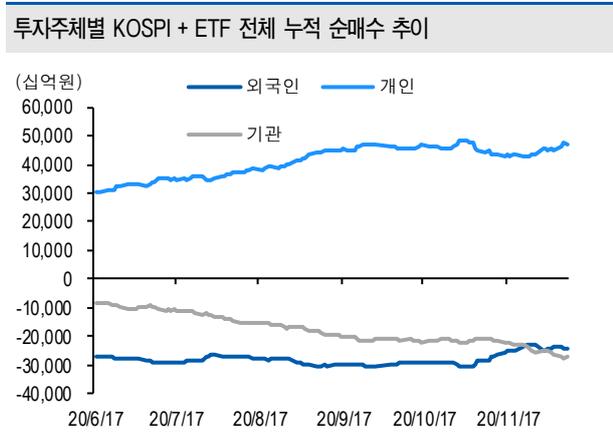


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.01	-0.05	-0.22	-0.02%	
베이스스(mini)	0.01	-0.05	-0.29	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-3.32	-5.16	-5.10	-0.50%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.22	-0.22	-0.06%	

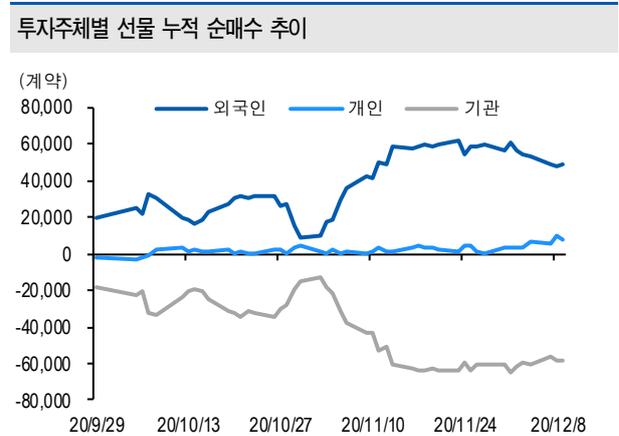


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	162.6	-75.6	86.9	-1.3	109.3	-344.6	393.5	-0.9	9.8	81.0	
개인	-506.2	18.6	-487.6	0.0	0.0	-197.1	-6.8	-5.3	-3.4	-42.4	
기관	305.8	51.3	357.2	11.4	-159.0	442.2	-396.5	4.0	-1.3	-42.1	
금융투자	525.9	6.4	532.3	0.0	39.7	-20.1	-397.1	2.7	-1.2	-17.5	
투신	-49.9	5.7	-44.2	0.0	-31.5	441.6	0.6	1.4	-0.1	37.5	
은행+보험+기타금융	-29.8	47.9	18.1	0.9	-27.6	-12.2	0.0	0.0	0.0	-13.4	
연기금+국가자재	-158.4	-10.3	-168.7	10.5	-152.2	32.9	0.0	0.0	0.0	-48.7	
기타법인	37.8	5.7	43.6	0.0	0.1	99.5	9.8	2.2	-5.1	3.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,813,108	752.5	1,018,425	15.4%	지수옵션 전체	4,863,337	1,105.7	3,175,227
Put	2,050,229	353.2	2,156,802	22.3%	PCR(금액기준)	0.47	VKOSPI	20.15%(-0.55%p)

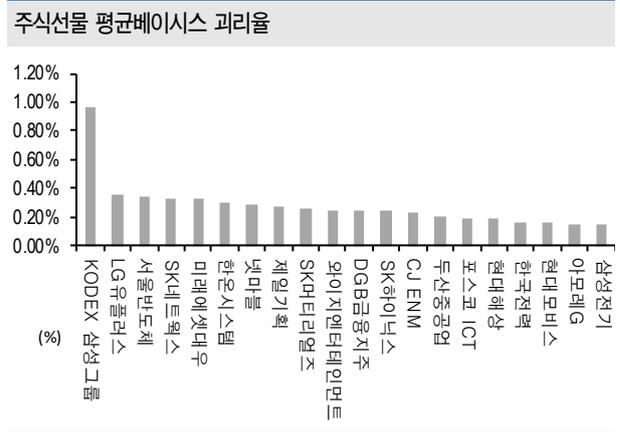
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	2.57	2.02	382,710	20,749	-2,747	15.8	Put	365.0(K+1)	0.29	-3.09	290,880	24,140	14,132	19.6
	367.5(K+2)	4.35	3.31	238,385	16,643	-1,539	15.1		362.5(K+0)	0.16	-1.94	325,122	18,720	6,038	21.6
	365.0(K+1)	6.54	4.70	88,388	16,513	1,403	13.5		360.0(K-1)	0.08	-1.14	334,088	30,771	11,167	23.0
	362.5(K+0)	8.91	5.86	29,474	11,902	-151	0.2		357.5(K-2)	0.05	-0.64	228,287	32,680	10,870	25.2
	360.0(K-1)	11.30	6.62	6,053	12,662	-967	22.3		355.0(K-3)	0.03	-0.37	151,032	21,870	295	27.1

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	5,712,795	5,154.5	7,018,466	188,218	112,680	-2,150	-119,210	81.0	-42.4	-42.1		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	74,000	3.35	1,608.0	91.4	817,056	-201,164	0.04%	46,671	6,943	-55,703	-44,095	-24,504
LG 화학	838,000	3.84	202.1	62.6	17,216	-9,607	-0.31%	1,298	-1,318	-86	555	211
한국금융지주	78,600	6.50	16.5	60.5	30,608	-2,556	0.13%	1,352	1,361	-2,726	242	-3,034
SK 하이닉스	121,000	5.68	365.1	56.1	255,435	-16,056	0.24%	3,234	8,730	-11,748	-12,748	-5,104
LG 전자	96,300	0.94	99.9	49.1	78,699	-6,601	0.07%	-6,105	-3,728	9,808	4,301	2,766
한화솔루션	46,750	-0.85	55.2	48.5	58,178	-26,731	0.07%	-5,440	-350	5,807	3,019	174
현대차	192,000	3.23	164.4	48.0	47,526	-12,615	0.01%	745	-739	-164	-263	-130
엔씨소프트	879,000	0.69	52.1	47.8	2,558	-482	0.01%	-416	141	276	136	131
삼성 SDI	568,000	2.71	110.0	47.2	13,242	-3,485	0.12%	-191	-973	1,172	-9	792
기아차	63,900	1.75	53.8	42.4	121,070	-9,463	0.06%	2,882	2,165	-5,053	-427	-13,008

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터