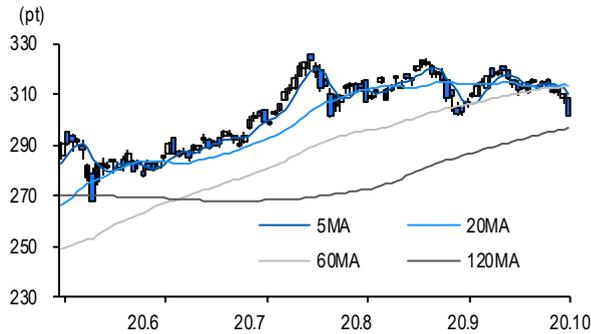


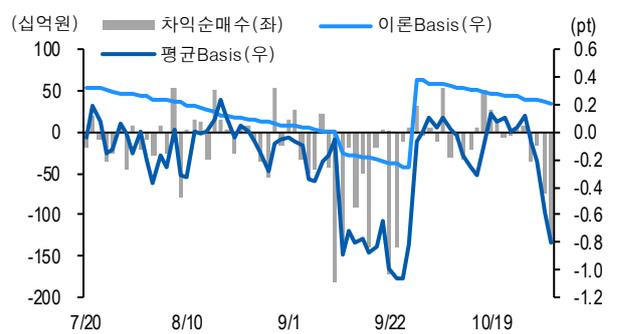


선물옵션시장 지표 2020.11.2

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	301.60	-2.69	-8.34	8,294.5	-
선물 12월물	301.80	-2.39	-7.40	23,577.2	292,361
선물 3월물	297.85	-2.36	-7.20	21.7	16,598
11월물(mini)	301.96	-2.42	-7.50	2,941.3	70,381
12월물(mini)	301.82	-2.39	-8.14	58.9	49,532

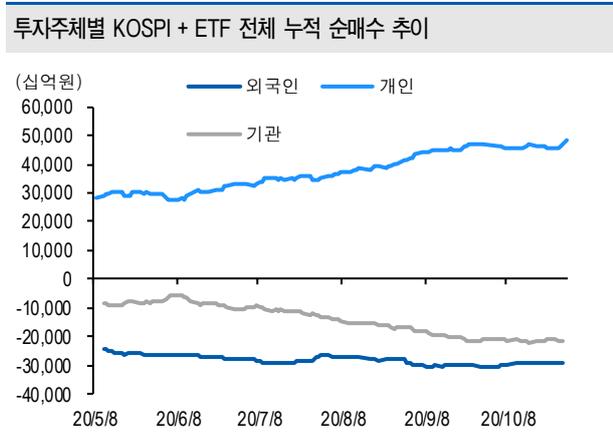


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.21	-0.80	0.20	-0.34%	
베이스스(mini)	0.07	-0.55	0.36	-0.20%	
제1스프레드(SP)	-3.47	-4.21	-4.15	-0.24%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.07	0.38	0.38	0.10%	

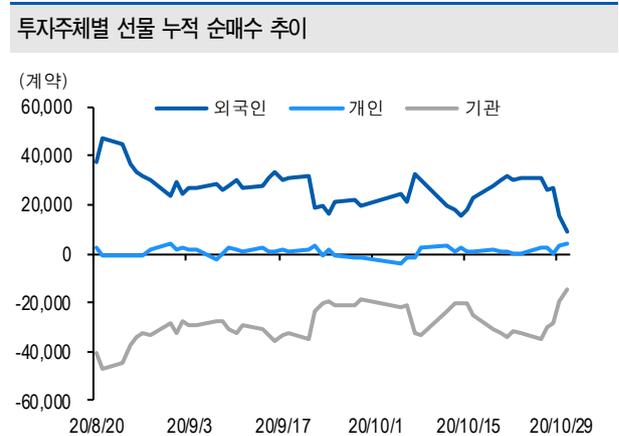


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-993.9	-7.2	-1,001.1	-12.8	-955.3	-365.8	-111.7	-4.0	-5.8	-41.1
개인	1,414.7	105.7	1,520.5	0.0	2.3	71.7	12.8	0.9	7.5	-11.0
기관	-458.0	-118.9	-576.9	-118.0	-43.8	289.7	98.6	3.1	-2.7	57.6
금융투자	-334.3	-114.3	-448.6	-136.1	-8.5	431.0	100.8	3.3	-2.7	83.8
투신	-23.5	-32.4	-55.9	0.0	-7.2	-174.6	-2.1	-0.2	0.0	-47.5
은행+보험+기타금융	-15.5	10.2	-5.4	0.0	1.2	61.9	0.0	0.0	0.0	-1.0
연기금+국가자재	-32.1	-10.2	-42.3	18.1	-2.9	-28.6	-0.1	0.0	0.0	22.3
기타법인	37.2	20.3	57.5	0.0	0.1	4.5	0.3	0.0	1.1	-5.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	889,462	250.8	794,514	24.4%	지수옵션 전체	2,287,784	761.3	2,163,048
Put	1,398,322	510.5	1,368,534	28.2%	PCR(금액기준)	2.04	VKOSPI	31.97%(+6.07%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	1.01	-1.26	97,239	16,828	4,793	23.9	Put	312.5(K+1)	12.70	5.41	841	4,786	-37	23.9
	315.0(K+2)	1.51	-1.64	73,464	13,878	2,560	24.7		310.0(K+0)	11.05	4.98	2,795	8,024	-388	25.1
	312.5(K+1)	2.15	-2.10	47,386	7,163	1,428	25.4		307.5(K-1)	9.60	4.55	9,283	7,724	1,089	26.3
	310.0(K+0)	3.03	-2.49	24,609	8,567	1,318	26.6		305.0(K-2)	8.23	4.04	17,591	12,591	-98	27.1
	307.5(K-1)	4.05	-2.94	16,862	5,489	2,888	27.6		302.5(K-3)	7.15	3.70	25,927	12,704	505	28.5

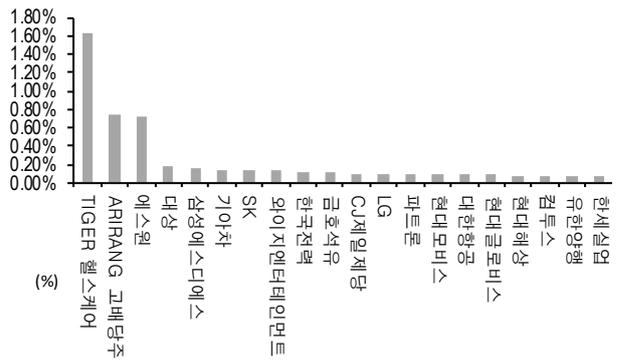
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,208,646	3,297.0	5,469,775	-139,373	-68,205	-26,936	105,291	-41.1	-11.0	57.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한화솔루션	43,500	-4.81	162.2	78.8	93,670	-4,128	-0.02%	5,209	820	-5,982	-2,218	-4,292
삼성전자	56,700	-2.58	1,100.2	72.8	1,195,663	-53,797	-0.17%	-34,780	-8,585	51,698	116,253	-23,062
현대차	164,500	-3.24	162.9	67.6	71,035	3,329	-0.07%	-3,059	-3,142	6,659	5,014	1,597
롯데케미칼	232,000	-3.53	54.2	66.2	22,310	-1,935	0.02%	126	50	-183	-481	818
LG 화학	612,000	-6.13	292.0	60.7	24,105	-373	0.07%	-1,179	1,000	178	-625	886
NAVER	290,000	-3.01	154.2	55.9	30,419	-8,745	-0.05%	-1,848	1,268	591	1,866	1,264
기아차	51,000	-3.95	71.4	54.4	211,234	3,952	0.14%	550	4,651	-5,402	-1,098	-1,020
삼성 SDI	440,000	2.21	270.7	54.4	14,076	824	-0.02%	3,577	-1,866	-2,048	-1,373	-1,324
대한유화	193,500	-0.51	17.5	52.3	8,249	1,340	0.07%	584	-1,113	443	106	-206
SK 하이닉스	79,800	-2.09	112.1	51.4	158,508	-222	-0.09%	-2,693	1,997	2,261	6,341	2,581

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터