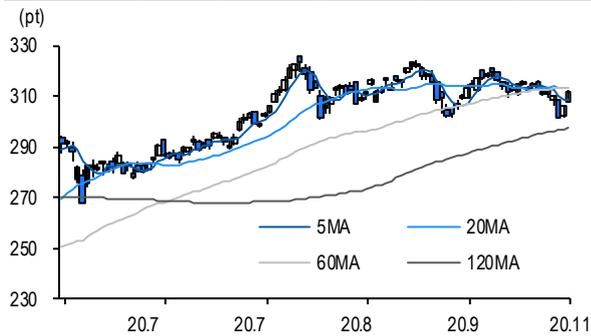


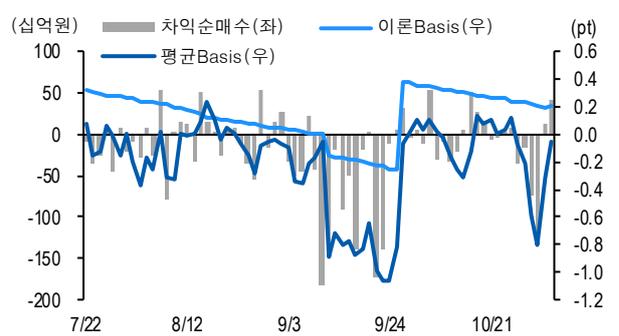


선물옵션시장 지표 2020.11.4

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.07	2.00	6.12	7,054.6	-
선물 12월물	312.10	2.13	6.50	19,816.9	280,258
선물 3월물	307.80	2.12	6.40	22.3	16,765
11월물(mini)	312.12	2.08	6.36	2,130.2	80,348
12월물(mini)	312.00	2.09	6.48	37.7	51,292

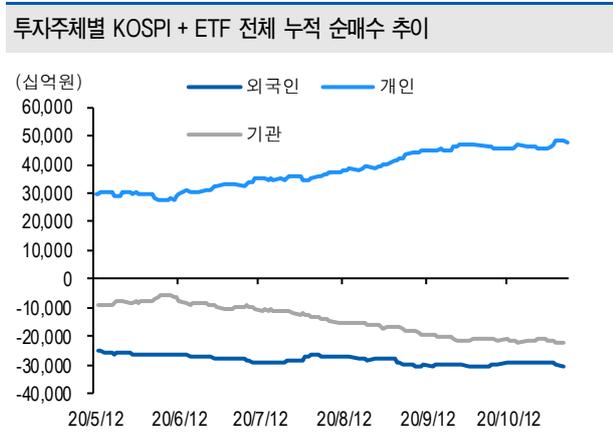


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.21	-0.05	0.03	-0.08%	
베이스스(mini)	0.05	-0.04	0.05	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.44	-4.26	-4.15	-0.26%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	0.02	0.02	-0.01%	

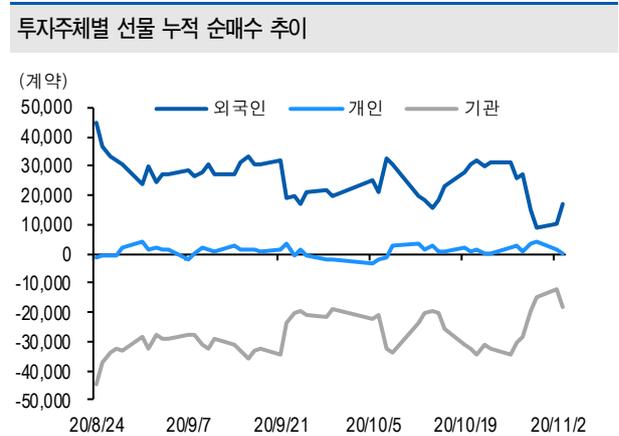


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	203.5	13.1	216.6	0.0	197.4	339.3	204.1	1.4	-6.6	16.0
개인	-653.7	-61.6	-715.3	0.0	-1.0	-92.1	0.3	1.8	0.8	-7.5
기관	454.0	48.0	502.0	41.3	16.2	-251.6	-202.2	-3.8	5.9	-7.3
금융투자	295.3	44.5	339.8	0.0	11.2	-634.5	-202.5	-2.8	6.4	12.3
투신	18.7	26.7	45.4	0.0	-3.9	500.2	0.4	-0.5	0.0	10.6
은행+보험+기타금융	10.1	-11.2	-1.1	0.0	-5.1	-78.8	0.0	-0.5	-0.5	-0.4
연기금+국가자차체	100.9	-10.7	90.2	41.3	15.7	-38.5	0.0	0.0	0.0	-29.7
기타법인	-3.9	0.5	-3.4	0.0	0.1	4.4	-2.3	0.5	-0.1	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,033,850	370.8	847,853	25.0%	지수옵션 전체	2,037,058	646.1	2,364,761
Put	1,003,208	275.2	1,516,908	30.9%	PCR(금액기준)	0.74	VKOSPI	26.54%(-2.11%p)

	Call				Put									
	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	5.04	2.59	55,722	10,566	955	25.3	307.5(K+1)	3.69	-2.81	18,789	7,760	1,254	27.9
	310.0(K+2)	6.53	3.06	20,096	10,516	577	26.3	305.0(K+0)	3.01	-2.44	26,652	14,728	237	29.0
	307.5(K+1)	8.22	3.53	5,160	5,198	-360	27.4	302.5(K-1)	2.46	-2.07	37,829	14,508	205	30.1
	305.0(K+0)	10.10	3.95	4,304	3,853	-234	28.8	300.0(K-2)	2.02	-1.75	59,811	19,224	-77	31.3
	302.5(K-1)	11.95	4.24	903	1,875	-196	29.3	297.5(K-3)	1.65	-1.47	44,816	10,708	502	32.4

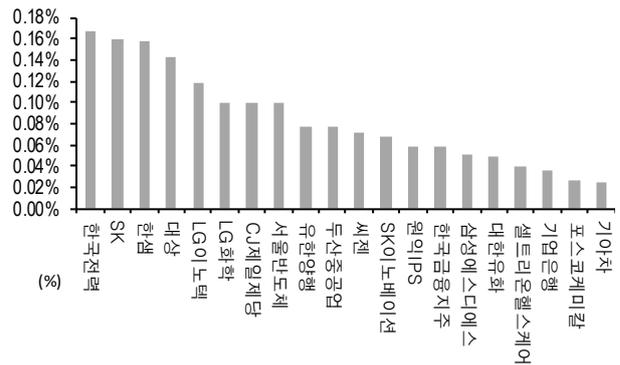
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,550,298	2,899.2	5,492,705	25,098	-2,468	-12,690	15,644	16.0	-7.5	-7.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	58,700	2.62	816.0	93.7	1,062,812	-59,376	-0.11%	13,594	-26,125	12,670	23,156	-7,009
현대차	171,000	0.00	139.2	81.5	81,250	2,233	-0.10%	-2,386	1,482	918	3,263	110
카카오	337,500	1.20	101.3	75.1	27,517	-1,623	-0.08%	-325	-119	425	695	432
삼성 SDI	460,500	4.66	232.0	71.3	17,288	5,198	0.00%	1,170	3,029	-3,954	-698	-3,964
SK 하이닉스	81,400	2.26	117.3	70.7	153,715	-2,821	-0.04%	14,131	-6,097	-8,053	-92	-6,510
LG 전자	86,400	1.53	24.7	70.1	25,327	90	-0.18%	784	675	-1,444	-2,594	-2,659
LG 화학	661,000	5.59	267.3	64.5	24,966	1,540	0.10%	228	-1,805	1,568	-45	-1,122
대림산업	78,400	1.42	9.4	63.2	31,330	-560	0.02%	-214	-456	638	34	616
롯데케미칼	249,500	5.50	51.4	62.1	21,698	-2,587	-0.01%	-29	-560	615	-730	1,587
엔씨소프트	787,000	0.00	23.3	61.4	4,358	-38	-0.04%	-7	12	-5	-41	41

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터