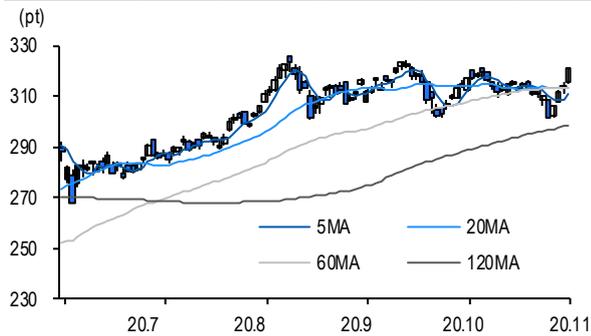


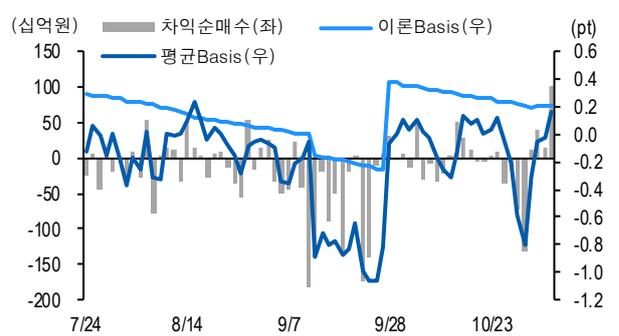


선물옵션시장 지표 2020.11.6

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	321.51	2.45	7.68	9,356.0	-	
선물 12월물	320.90	2.26	7.10	24,929.1	275,689	
선물 3월물	316.35	2.25	6.95	36.4	17,694	
11월물(mini)	320.74	2.24	7.02	2,763.3	98,141	
12월물(mini)	320.58	2.16	6.84	70.1	62,035	

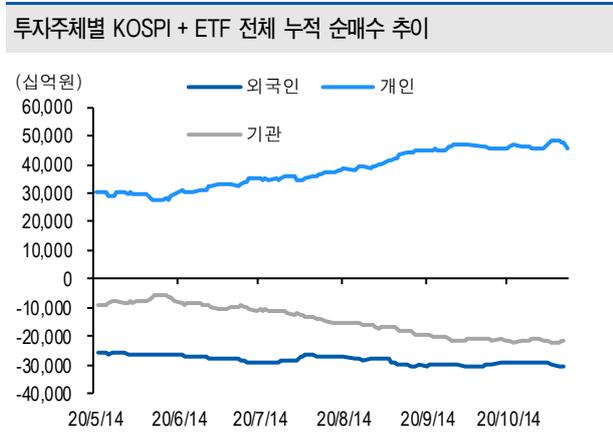


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.20	0.16	-0.61	-0.01%	
베이스스(mini)	0.04	0.08	-0.77	0.01%	
제1스프레드(SP)	-3.40	-4.44	-4.45	-0.32%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	-0.83	-0.83	-0.27%	

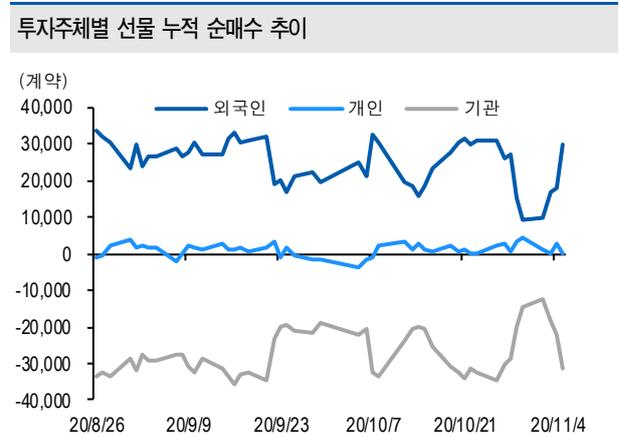


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	1,132.2	3.2	1,135.4	71.8	591.1	799.1	138.7	-0.1	-1.2	24.2	
개인	-1,618.6	74.0	-1,544.6	0.0	0.0	-153.4	-30.7	3.8	-0.2	66.8	
기관	485.3	-84.0	401.4	29.6	-59.2	-641.3	-106.2	-4.5	1.9	-96.7	
금융투자	446.2	-11.9	434.3	38.6	26.6	-945.9	-105.9	-4.5	2.5	-99.0	
투신	60.2	-21.3	38.9	0.0	16.0	366.9	-0.2	0.0	0.1	82.5	
은행+보험+기타금융	-7.9	-63.8	-71.7	3.2	-25.3	-57.5	-0.1	0.0	-0.7	0.4	
연기금+국가지자체	-44.8	-3.1	-47.9	-12.2	-72.6	-4.8	0.0	0.0	0.0	-80.7	
기타법인	1.0	6.9	7.9	0.0	-0.6	-4.4	-1.8	0.8	-0.5	5.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,206,102	395.5	847,045	15.4%	지수옵션 전체	2,481,636	625.6	2,527,198
Put	1,275,534	230.1	1,680,153	23.7%	PCR(금액기준)	0.58	VKOSPI	22.16%(-2.59%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	2.52	1.36	157,428	18,218	-2,551	15.6	Put	317.5(K+1)	2.24	-4.24	37,935	8,628	4,078	20.9
	320.0(K+2)	3.80	1.95	114,566	19,807	-2,473	15.6		315.0(K+0)	1.64	-3.54	63,524	11,082	4,783	21.9
	317.5(K+1)	5.43	2.68	41,861	20,179	1,214	15.7		312.5(K-1)	1.19	-2.93	58,679	10,579	3,754	22.8
	315.0(K+0)	7.32	3.38	12,933	16,148	733	15.7		310.0(K-2)	0.88	-2.38	79,748	15,383	4,994	24.0
	312.5(K-1)	9.43	4.07	6,215	9,158	-811	15.5		307.5(K-3)	0.65	-1.91	69,154	11,390	2,573	25.1

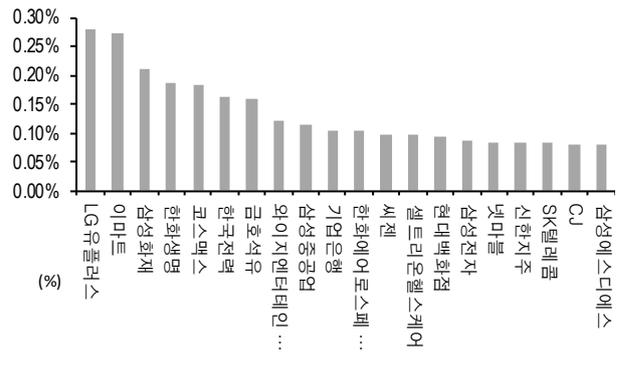
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,356,711	3,383.5	5,825,174	277,779	95,645	72,100	-175,919	24.2	66.8	-96.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	156,000	0.00	23.0	110.1	18,847	-63	-0.26%	-6,458	63	6,394	3,221	3,082
삼성전자	60,200	2.73	899.8	74.0	1,137,993	56,858	0.09%	57,201	13,880	-71,804	-75,353	-53,528
SK 하이닉스	86,000	3.12	227.2	65.3	200,164	52,785	-0.01%	-5,058	13,561	-8,198	-18,689	-26,153
카카오	363,500	0.83	245.3	64.4	27,772	128	0.04%	-2,178	-538	2,688	-660	1,677
기아차	52,200	1.36	71.9	57.3	167,282	-8,861	0.01%	-4,191	1,382	2,562	5,537	6,609
LG 화학	677,000	4.31	168.1	57.0	25,978	1,455	0.03%	2,295	936	-3,218	-511	-1,738
삼성 SDI	484,500	5.56	185.0	53.9	21,555	5,749	0.04%	760	1,404	-2,729	-1,357	-3,356
롯데케미칼	245,000	2.08	76.3	53.3	10,173	-6,317	-0.16%	-259	683	-457	971	3,648
현대차	175,500	2.63	115.2	51.5	76,431	-776	-0.03%	2,955	1,031	-4,383	-553	-4,401
삼성전기	141,000	1.08	24.9	50.0	22,971	3,997	-0.09%	673	4,217	-4,911	-4,184	-553

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터