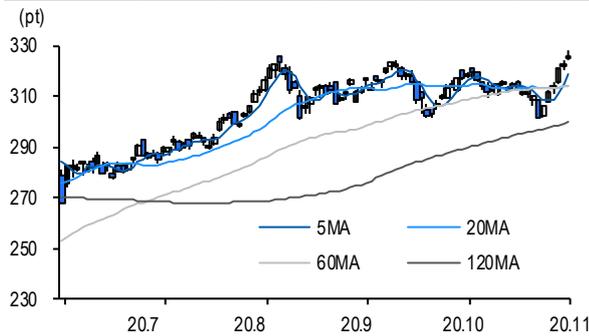


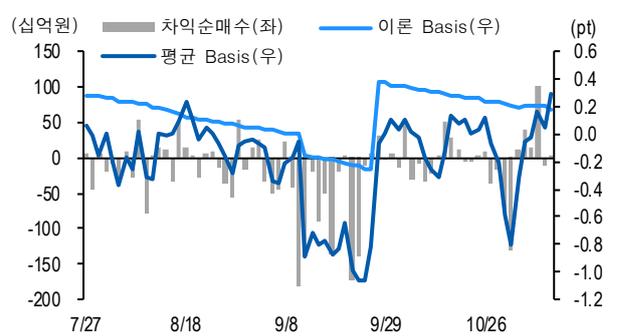


선물옵션시장 지표 2020.11.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	325.83	1.16	3.73	9,713.3	-
선물 12월물	325.75	1.21	3.90	22,194.8	280,985
선물 3월물	321.35	1.24	3.95	36.0	17,952
11월물(mini)	325.70	1.21	3.88	2,918.3	110,082
12월물(mini)	325.60	1.16	3.60	220.9	62,508

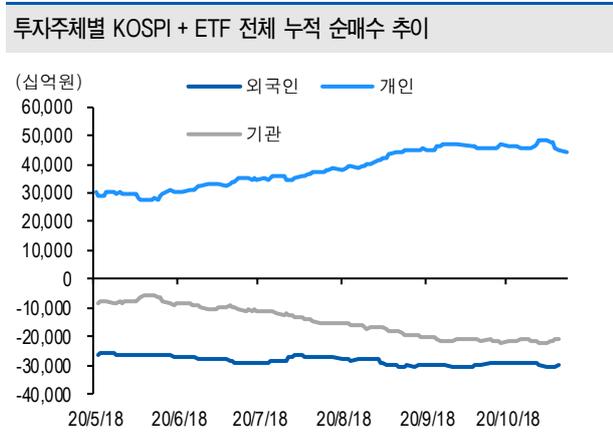


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.18	0.30	-0.08	0.04%	
베이스(mini)	0.02	0.23	-0.13	0.07%	
제1스프레드(SP)	-3.40	-4.48	-4.50	-0.33%	
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.08	-0.08	-0.03%	

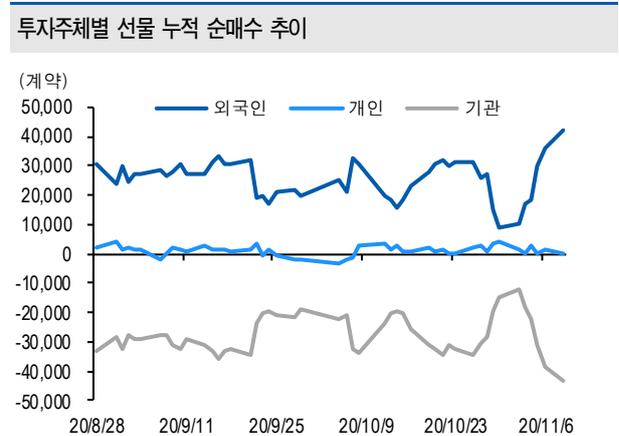


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	328.2	39.9	368.2	1.6	183.1	36.2	476.8	-2.9	0.1	-5.8
개인	-677.8	-115.5	-793.3	0.0	3.1	-127.9	-1.8	8.2	-2.4	0.9
기관	356.3	66.2	422.6	0.4	-172.5	86.5	-474.5	-5.2	2.5	1.1
금융투자	581.1	277.2	858.3	0.0	-1.5	302.9	-474.1	-5.5	2.7	-36.7
투신	-17.3	-38.6	-55.9	0.0	-29.6	-182.3	-0.3	0.4	-0.2	27.5
은행+보험+기타금융	-45.0	-186.8	-231.8	0.0	-37.3	-1.8	0.0	-0.1	0.0	-2.7
연기금+국가자재	-165.9	-7.7	-173.6	0.4	-102.7	-32.2	0.0	0.0	0.0	12.9
기타법인	-6.8	9.3	2.6	0.0	0.4	5.1	-0.6	-0.1	-0.2	3.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,318,517	595.6	939,368	19.0%	지수옵션 전체	3,861,615	848.7	2,830,845
Put	1,543,098	253.2	1,891,477	21.2%	PCR(금액기준)	0.43	VKOSPI	21.58%(-0.16%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	1.03	0.52	370,475	34,695	-1,348	18.9	Put	325.0(K+1)	2.26	-2.57	120,275	10,521	8,318	19.6
	327.5(K+2)	1.83	0.87	239,378	25,022	743	18.8		322.5(K+0)	1.35	-2.06	168,706	15,932	10,476	20.0
	325.0(K+1)	3.02	1.36	97,499	26,329	-1,767	18.9		320.0(K-1)	0.78	-1.56	174,526	20,033	7,941	20.6
	322.5(K+0)	4.60	1.85	27,618	17,797	-860	19.1		317.5(K-2)	0.45	-1.14	121,521	18,451	4,270	21.6
	320.0(K-1)	6.54	2.37	11,889	16,898	-1,092	19.6		315.0(K-3)	0.25	-0.84	147,179	25,484	8,783	22.4

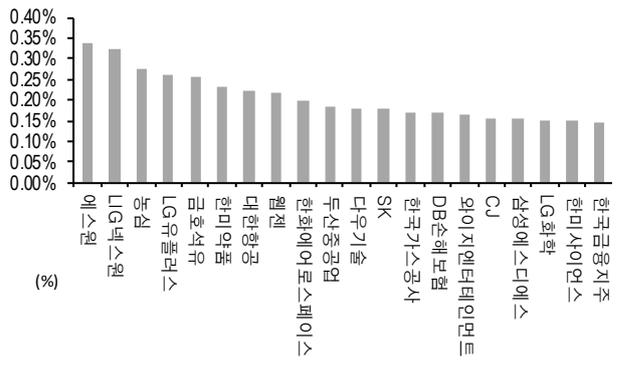
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,264,006	3,319.2	6,032,189	188,331	31,942	50,220	-89,179	-5.8	0.9	1.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대림산업	81,700	3.68	27.4	81.6	24,610	-1,952	0.08%	1,882	1,069	-2,907	-2,062	-1,371
LG 화학	739,000	1.93	347.1	79.0	29,668	-725	0.15%	-1,192	-1,405	2,581	-1,247	426
삼성전자	60,200	0.17	712.8	75.1	986,723	-110,494	0.02%	7,351	13,067	-20,583	-3,852	16,039
카카오	372,000	0.54	141.8	64.5	22,744	-7,433	0.11%	-1,215	1,214	4	-266	-1,511
SK 하이닉스	85,900	-0.46	130.5	63.4	199,539	-20,735	0.02%	-2,291	-1,284	3,467	381	17,390
삼성 SDI	532,000	6.40	222.1	51.4	21,601	-780	0.03%	-169	-1,352	1,326	-963	2,653
GS 건설	29,200	3.73	13.2	49.5	35,272	-15,982	-0.18%	-108	-3,004	3,102	3,829	-751
NAVER	297,500	-1.33	94.5	46.5	30,256	-573	0.09%	-248	-253	517	-38	275
롯데케미칼	274,500	9.15	76.6	46.5	11,987	-1,550	-0.02%	628	-1,178	531	482	2,164
현대차	172,500	1.17	121.6	46.3	73,970	-1,943	0.09%	256	841	-1,188	-363	-1,139

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터