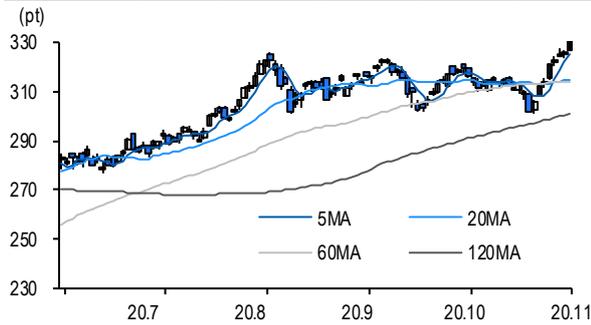


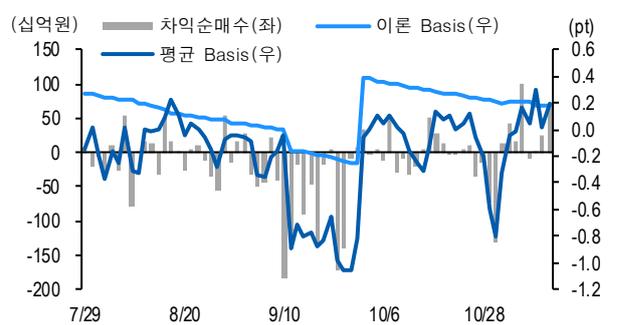


선물옵션시장 지표 2020.11.12

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	331.12	1.53	4.99	12,300.8	-
선물 12월물	331.25	1.56	5.10	24,644.2	288,400
선물 3월물	326.85	1.60	5.15	39.5	18,393
11월물(mini)	331.22	1.56	5.08	3,219.1	104,949
12월물(mini)	331.20	1.55	4.90	336.2	72,353

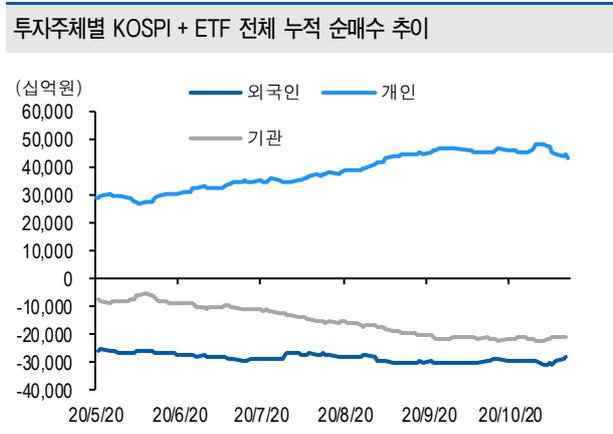


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.17	0.20	0.13	0.01%
베이스(mini)	0.01	0.14	0.10	0.04%
제1스프레드(SP)	-3.39	-4.53	-4.45	-0.34%
합성선물 베이스(ATM)	0.01	0.05	0.05	0.01%

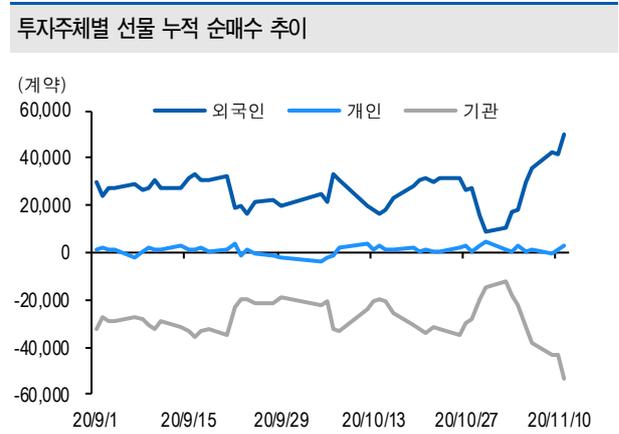


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	835.2	42.7	877.8	55.8	454.6	334.1	355.5	-1.0	-0.8	13.4
개인	-1,189.8	14.1	-1,175.7	0.0	-0.6	173.0	-2.4	2.4	-0.2	43.8
기관	401.9	-46.8	355.1	11.5	-80.6	-494.7	-353.8	-1.0	2.3	-57.3
금융투자	491.9	32.4	524.3	0.0	1.9	-641.6	-354.4	-2.0	2.5	-72.4
투신	-61.3	-46.3	-107.5	0.0	-58.3	205.9	0.7	1.0	-0.1	9.8
은행+보험+기타금융	-13.4	-33.3	-46.7	0.0	-13.6	-46.6	0.0	0.0	-0.1	-0.1
연기금+국가자자체	6.5	1.2	7.6	11.5	-10.7	-12.4	-0.1	0.0	0.0	5.4
기타법인	-47.2	-10.0	-57.2	0.0	0.1	-12.4	0.7	-0.4	-1.3	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,400,183	555.2	991,487	17.8%	지수옵션 전체	4,134,531	814.5	3,049,975
Put	1,734,348	259.3	2,058,488	20.4%	PCR(금액기준)	0.47	VKOSPI	20.68%(-0.34%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	1.12	0.72	415,185	26,521	701	17.5	Put	327.5(K+1)	0.45	-2.59	261,625	24,829	18,418	17.2
	330.0(K+2)	2.29	1.45	340,447	27,112	-9,330	17.0		325.0(K+0)	0.18	-1.53	327,358	31,983	16,398	18.6
	327.5(K+1)	4.12	2.53	140,638	23,644	-2,251	17.8		322.5(K-1)	0.08	-0.82	254,565	33,632	13,630	20.4
	325.0(K+0)	6.35	3.55	46,060	23,893	-2,564	19.5		320.0(K-2)	0.05	-0.40	206,098	33,042	7,423	23.3
	322.5(K-1)	8.76	4.29	7,134	17,638	-835	22.4		317.5(K-3)	0.03	-0.20	145,912	27,661	723	25.8

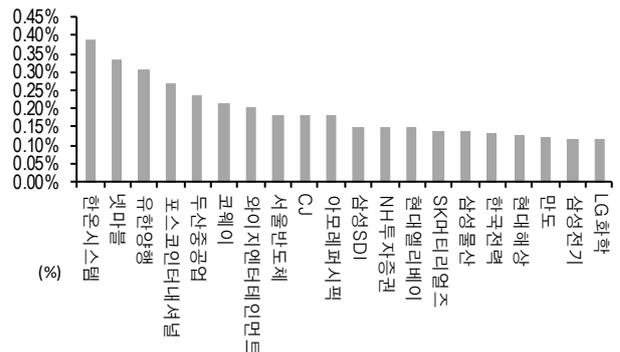
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,914,142	4,469.1	6,425,773	326,370	14,985	91,699	-98,741	13.4	43.8	-57.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	695,000	-1.56	256.3	68.9	17,032	-5,631	0.12%	1,189	-1,745	554	461	201
SK 하이닉스	87,100	0.69	144.0	66.0	158,109	-17,758	0.02%	-1,478	17,207	-15,736	2,502	-9,000
LG 디스플레이	15,100	2.03	16.6	65.5	187,077	-85,947	-0.38%	8,347	-320	-8,018	-3,012	-2,325
기아차	58,100	6.22	148.7	58.2	138,585	-30,362	0.03%	-3,966	-8,996	13,636	-1,238	12,815
대림산업	83,800	1.95	21.1	56.1	15,561	-1,861	-0.02%	-1,022	1,201	-181	-605	422
삼성전자	61,400	1.99	794.6	51.8	657,479	-94,062	0.02%	-22,241	63,321	-46,647	-84,921	2,532
현대차	175,500	1.15	353.4	50.7	61,633	-11,020	0.04%	-2,475	-746	3,103	-678	2,651
현대모비스	244,000	0.83	50.7	49.4	17,095	-3,425	0.01%	-1,061	-400	1,462	1,703	473
LG 이노텍	152,000	1.00	9.1	48.5	10,893	-675	-0.23%	795	-258	-548	-886	-370
카카오	355,500	-0.42	116.9	46.4	11,341	-6,503	0.04%	2,036	-401	-1,654	-203	-1,060

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터