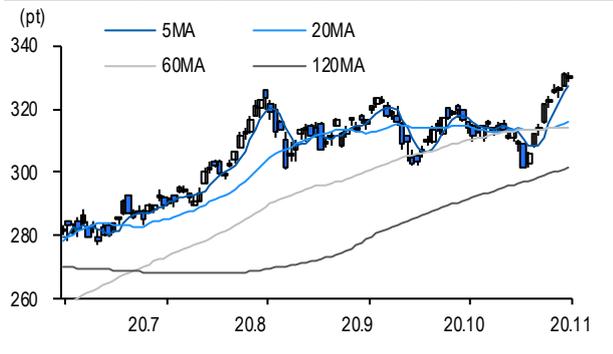
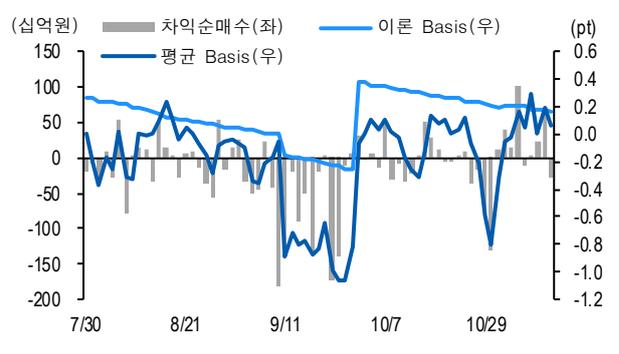


선물옵션시장 지표 2020.11.13

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	329.72	-0.42	-1.40	9,766.7	-
선물 12월물	329.60	-0.50	-1.65	27,616.0	274,708
선물 3월물	325.25	-0.49	-1.60	24.2	18,294
11월물(mini)	329.70	-0.46	-1.52	1,694.1	0
12월물(mini)	329.82	-0.43	-1.38	2,232.5	100,389

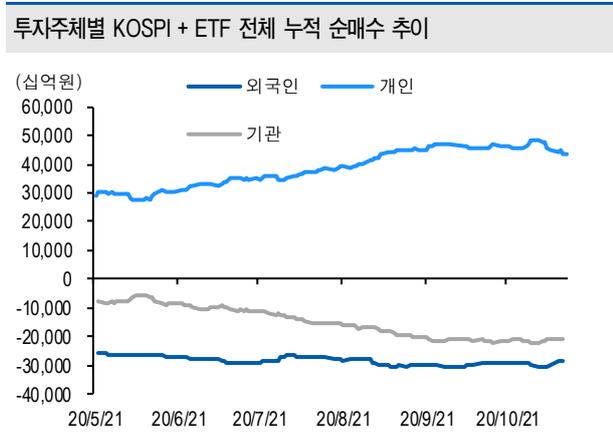


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.17	0.07	-0.12	-0.03%	
베이스스(mini)	0.00	-0.01	-0.02	0.00%	
제1스프레드(SP)	-3.39	-4.50	-4.45	-0.34%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	-0.11	-0.11	-0.03%	

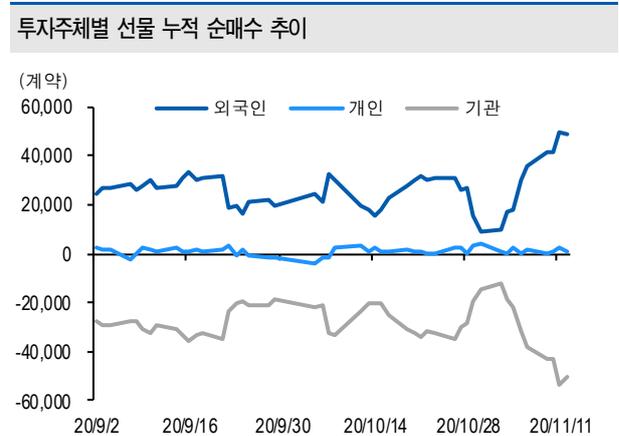


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	490.5	22.8	513.3	2.0	368.0	516.7	-615.9	-11.9	0.5	-14.3	
개인	354.6	11.5	366.1	0.0	0.2	-134.0	-2.2	1.5	3.7	41.0	
기관	-861.2	-32.6	-893.8	-29.6	-187.6	-384.2	617.2	8.4	-4.6	-25.4	
금융투자	-629.8	86.9	-542.9	0.0	-104.9	-194.9	616.9	-0.8	-1.6	21.6	
투신	-18.3	-105.7	-124.0	0.0	-11.6	-193.2	0.3	6.6	0.2	-8.6	
은행+보험+기타금융	-16.7	17.5	0.8	0.0	-7.0	-56.2	0.0	2.5	-3.1	-0.6	
연기금+국가자재	-132.9	-25.0	-157.9	-29.6	-48.1	60.1	0.1	0.1	0.0	-37.9	
기타법인	16.1	-1.8	14.4	0.0	0.1	1.5	0.9	2.0	0.3	-1.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,280,802	406.2	514,705	9.4%	지수옵션 전체	4,453,421	711.5	1,437,434
Put	2,172,619	305.4	922,729	10.0%	PCR(금액기준)	0.75	VKOSPI	19.85%(-0.83%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	0.01	-0.18	131,558	0	-51,618	18.8	Put	332.5(K+1)	2.90	0.46	122,881	0	-4,611	13.2
	335.0(K+2)	0.01	-0.48	428,655	0	-41,128	13.5		330.0(K+0)	0.63	-0.50	538,371	0	-16,669	7.0
	332.5(K+1)	0.02	-1.10	766,332	0	-26,521	8.7		327.5(K-1)	0.02	-0.43	691,064	0	-24,829	7.4
	330.0(K+0)	0.24	-2.05	567,419	0	-27,112	5.2		325.0(K-2)	0.01	-0.17	384,099	0	-31,983	12.5
	327.5(K-1)	2.14	-1.98	133,450	0	-23,644	5.5		322.5(K-3)	0.01	-0.07	126,871	0	-33,632	18.1

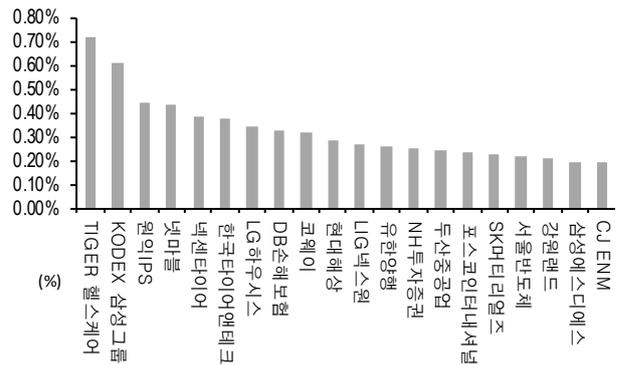
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,357,046	4,499.9	5,197,919	-1,227,854	-61,268	101,968	-35,336	-14.3	41.0	-25.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대모비스	240,000	-1.64	44.1	40.0	0	-17,095	-0.09%	1,163	380	-1,543	3,083	392
한세실업	17,800	-4.04	1.5	39.7	0	-7,616	-0.02%	-187	-84	266	64	180
현대차	174,500	-0.57	128.5	38.5	0	-61,633	-0.11%	415	994	-1,424	203	3,150
LG 화학	691,000	-0.58	99.0	37.5	0	-17,032	-0.08%	24	410	-484	448	369
기아차	58,900	1.38	98.5	36.9	0	-138,585	-0.13%	-2,473	-2,463	5,143	5,984	10,466
SK 하이닉스	88,000	1.03	119.6	36.1	0	-158,109	-0.02%	1,421	-363	-1,531	-5,083	-1,874
GS 건설	30,300	-2.26	6.1	32.1	0	-21,237	-0.02%	-1,640	2,240	-595	-3,204	-2,520
삼성전자	61,100	-0.49	343.3	32.1	0	-657,479	-0.08%	15,441	14,624	-27,769	4,504	-36,574
LG 이노텍	152,000	0.00	6.2	32.0	0	-10,893	0.03%	-375	92	294	136	-39
삼성 SDI	511,000	-0.58	75.1	30.9	0	-18,977	-0.11%	304	395	-746	-690	953

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터