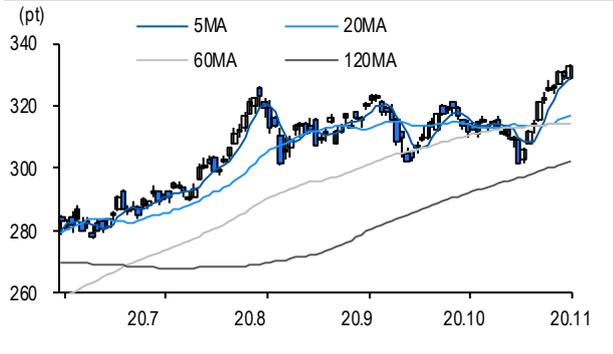


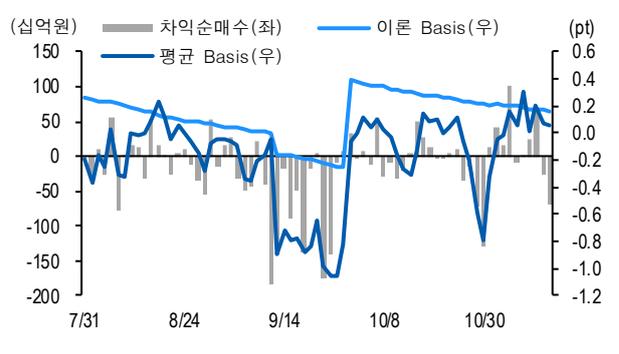


선물옵션시장 지표 2020.11.16

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	333.03	1.00	3.31	10,153.4	-
선물 12월물	333.10	1.06	3.50	22,955.6	273,793
선물 3월물	328.55	1.01	3.30	43.2	18,883
12월물(mini)	333.20	1.09	3.38	2,718.6	112,290
1월물(mini)	328.60	1.11	3.62	68.7	7,636

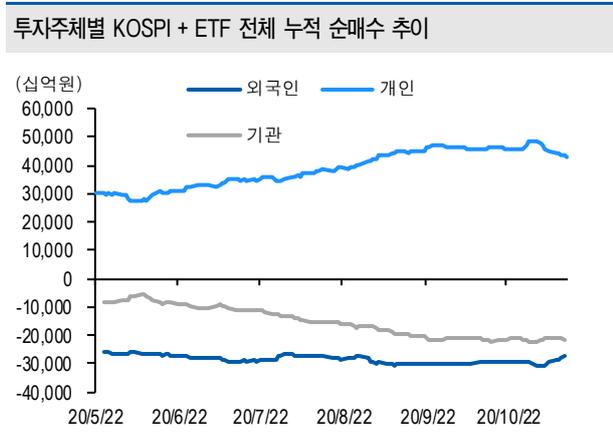


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.16	0.05	0.07	-0.03%	
베이스스(mini)	0.16	0.05	0.17	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.39	-4.51	-4.50	-0.34%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.16	0.11	0.11	-0.02%	

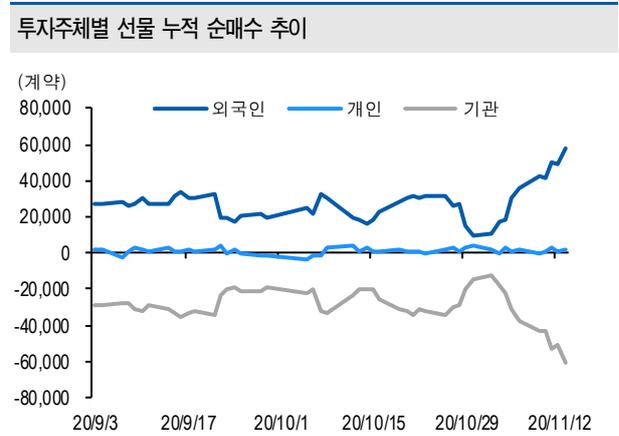


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	522.6	36.6	559.2	6.3	362.0	219.5	-91.8	1.6	1.8	-17.9
개인	-589.1	32.8	-556.3	0.0	1.2	48.0	-27.4	-0.2	-1.9	130.4
기관	93.6	-68.9	24.8	-74.9	-107.2	-273.6	124.3	-1.4	0.8	-117.5
금융투자	154.1	-73.0	81.2	0.0	-6.4	-308.4	123.9	0.2	2.5	-87.1
투신	-59.0	-12.0	-71.1	0.0	-52.8	-56.8	0.6	-1.6	-1.3	23.3
은행+보험+기타금융	-21.1	11.9	-9.2	0.0	-12.4	45.9	-0.1	0.0	-0.4	0.2
연기금+국가지자체	13.8	-1.9	11.9	-74.9	-45.0	45.6	-0.1	0.0	0.0	-53.9
기타법인	-27.1	-0.5	-27.7	0.0	0.0	6.0	-5.0	-0.1	-0.7	5.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	743,734	303.3	569,111	17.0%	지수옵션 전체	1,476,803	558.6	1,630,292
Put	733,069	255.2	1,061,181	19.0%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	19.77%(-0.08%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	4.34	1.21	31,031	5,593	1,372	16.9	Put	332.5(K+1)	6.13	-1.51	4,389	1,175	871	17.6
	335.0(K+2)	5.45	1.45	19,675	8,520	1,499	17.1		330.0(K+0)	5.10	-1.53	13,000	6,734	3,202	18.0
	332.5(K+1)	6.76	1.74	11,232	6,190	322	17.4		327.5(K-1)	4.23	-1.29	10,765	2,969	1,426	18.4
	330.0(K+0)	8.24	2.02	13,702	13,875	1,714	17.8		325.0(K-2)	3.50	-1.10	16,908	4,740	1,675	18.8
	327.5(K-1)	9.80	2.16	2,154	4,225	257	18.0		322.5(K-3)	2.90	-0.92	23,160	4,033	1,674	19.3

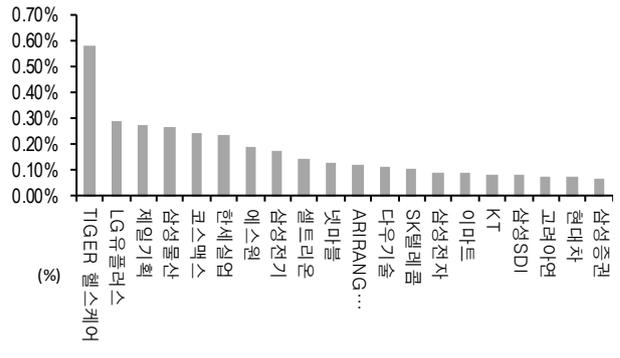
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,859,125	3,603.1	5,536,485	338,566	-67,599	126,521	-63,389	-17.9	130.4	-117.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	707,000	1.43	200.5	74.2	27,257	-583	0.04%	-337	393	-66	28	1,151
삼성전자	63,400	3.59	1,158.2	59.3	1,457,552	233,458	0.09%	-4,099	89,724	-90,721	-99,711	-55,413
NAVER	281,000	0.36	115.0	57.9	27,260	-1,443	0.02%	368	-2,842	2,465	442	134
한화솔루션	49,250	-0.20	143.1	57.7	86,053	1,403	0.01%	6,010	-7	-6,007	-4,386	-5,376
SK 하이닉스	89,900	1.93	191.1	56.9	222,405	38,988	0.03%	-317	17,917	-17,656	-3,703	-26,142
기아차	59,200	0.34	127.5	53.4	135,871	-14,584	-0.03%	-10,683	351	10,630	2,126	20,392
카카오	365,500	2.24	102.8	53.2	29,170	2,114	0.00%	855	1,697	-2,532	-1,593	-2,080
현대차	179,000	2.29	220.9	52.1	65,105	7,136	0.07%	2,810	3,976	-6,949	1,349	-8,793
삼성 SDI	504,000	-2.14	252.2	51.3	23,002	747	0.08%	603	846	-1,575	-2,238	1,735
신한지주	32,400	-1.67	53.7	50.7	106,930	-4,149	-0.03%	-26,528	-2,598	29,036	8,131	27,763

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터