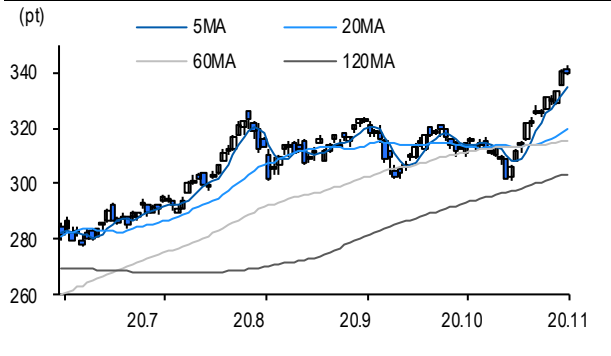


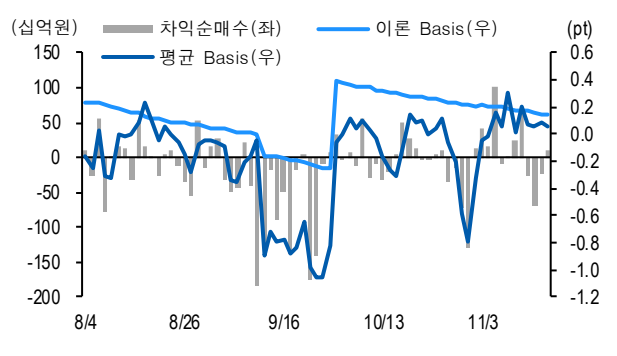


선물옵션시장 지표 2020.11.18

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.85	-0.23	-0.78	12,131.9	-
선물 12월물	340.25	0.04	0.15	20,941.3	271,627
선물 3월물	335.85	0.06	0.20	49.4	18,812
12월물(mini)	340.30	0.06	0.06	2,601.8	133,473
1월물(mini)	335.86	0.04	0.14	53.5	10,897

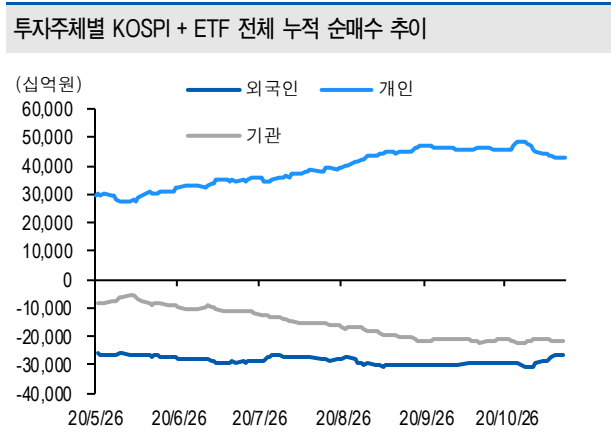


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.14	0.05	0.40	-0.03%	
베이스스(mini)	0.14	0.05	0.45	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.38	-4.50	-4.50	-0.33%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.14	0.40	0.40	0.08%	

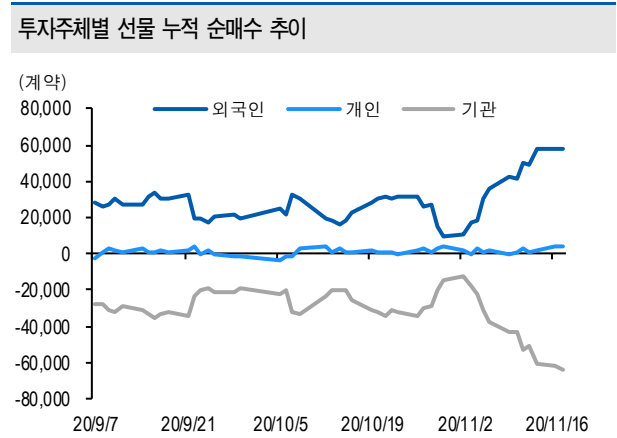


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	358.5	76.5	435.0	0.1	284.8	327.6	-299.7	-0.1	-2.7	-9.8
개인	154.1	30.1	184.2	0.0	-0.3	68.8	-0.6	-0.2	0.7	38.0
기관	-513.9	-99.7	-613.6	11.3	-182.1	-405.1	299.4	0.0	1.9	-26.5
금융투자	-260.0	23.2	-236.8	-2.2	-29.1	25.3	299.4	1.4	1.9	8.1
투신	-112.0	-92.7	-204.7	0.0	-95.5	-403.9	0.1	0.3	0.0	-24.1
은행+보험+기타금융	-57.5	-34.2	-91.7	0.0	-23.2	-29.0	0.0	-1.6	0.0	0.2
연기금+국가자재	-57.4	2.0	-55.4	13.5	-26.8	2.5	0.1	0.0	0.0	-10.8
기타법인	1.3	-6.8	-5.5	0.0	-1.5	8.7	0.8	0.3	0.1	-1.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





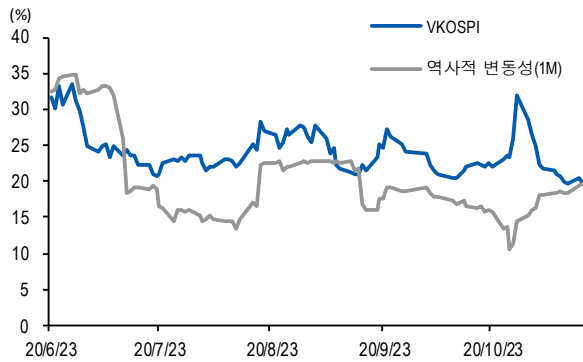
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	682,419	279.2	648,540	17.4%	지수옵션 전체	1,423,845	531.0	1,881,168
Put	741,426	251.7	1,232,628	18.0%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	19.72%(-0.78%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	3.07	-0.38	37,666	10,527	530	17.4	Put	342.5(K+1)	7.18	-0.59	3,268	1,341	601	16.8
	345.0(K+2)	3.91	-0.42	35,939	11,704	-615	17.4		340.0(K+0)	5.93	-0.57	17,173	6,004	3,259	17.1
	342.5(K+1)	4.95	-0.40	16,105	9,355	-141	17.5		337.5(K-1)	4.85	-0.53	13,208	4,811	957	17.4
	340.0(K+0)	6.18	-0.37	10,821	12,063	12	17.8		335.0(K-2)	3.95	-0.49	29,688	4,515	992	17.8
	337.5(K-1)	7.60	-0.36	4,010	5,634	-457	18.1		332.5(K-3)	3.21	-0.43	26,880	4,469	1,169	18.2

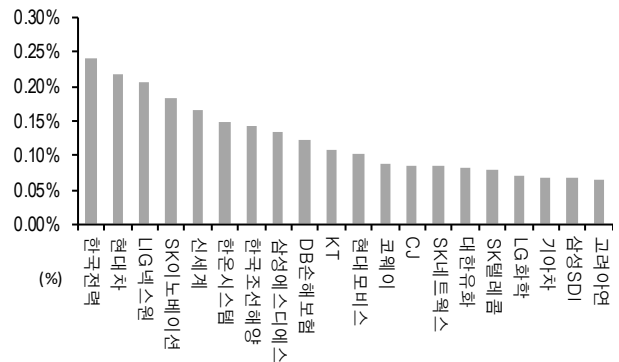
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,424,008	3,862.5	5,915,693	93,708	-36,139	69,615	-31,284	-9.8	38.0	-26.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	65,800	-0.75	1,428.2	71.7	1,475,563	16,523	0.04%	-17,177	6,117	15,091	-8,262	1,981
SK 하이닉스	98,200	0.20	360.0	70.3	251,952	9,903	0.06%	-4,536	12,469	-7,764	-7,884	-14,206
롯데케미칼	271,500	-0.55	57.6	64.1	8,718	-1,902	-0.02%	-172	-926	1,239	428	2,719
LG 화학	689,000	1.62	138.3	61.3	23,843	-1,170	0.07%	937	-255	-663	-381	-11
현대차	183,500	2.23	344.9	55.1	94,450	12,825	0.22%	-148	2,149	-2,050	-712	-6,882
대림산업	82,200	-1.20	12.3	54.4	23,542	-589	0.01%	-1,296	595	631	68	1,170
기아차	58,600	-1.84	103.1	54.3	158,012	11,867	0.07%	-5,215	3,107	1,598	1,717	-7,827
하나금융지주	36,700	1.10	49.2	51.5	97,932	-10,002	-0.10%	4,680	5,206	-9,345	9,041	-44
셀트리온	284,000	-1.90	133.3	50.9	44,342	-11,950	-0.14%	3,231	-153	-3,086	4,429	0
한화솔루션	48,550	0.10	79.0	48.6	85,382	1,298	0.03%	2,438	453	-2,892	-1,013	-3,881

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터