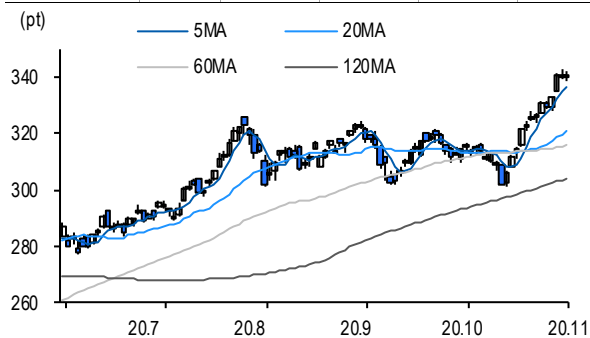


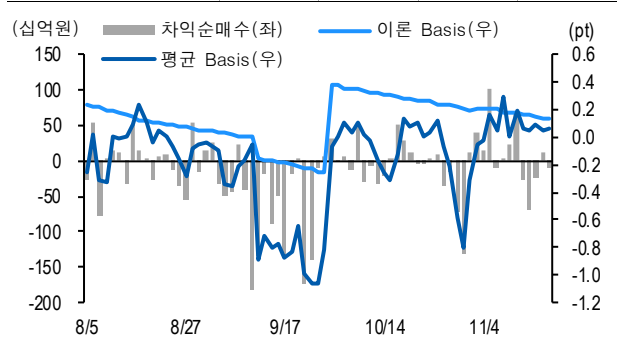
선물옵션시장 지표

2020.11.19

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.96	0.03	0.11	9,342.4	-
선물 12월물	339.95	-0.09	-0.30	20,252.2	270,644
선물 3월물	335.55	-0.09	-0.30	36.2	18,810
12월물(mini)	339.88	-0.11	-0.42	2,255.1	134,554
1월물(mini)	335.40	-0.14	-0.46	25.4	11,483



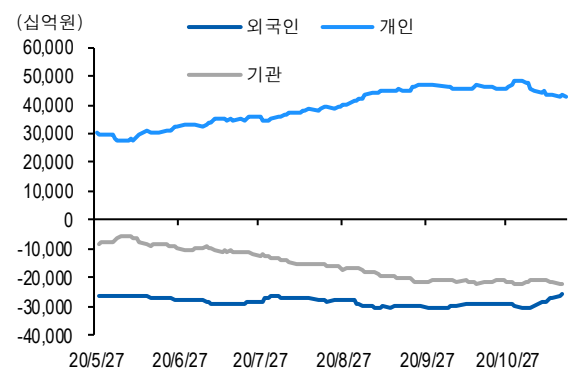
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.14	0.06	-0.01	-0.02%
베이스(mini)	0.14	0.06	-0.08	-0.02%
제1스프레드(SP)	-3.38	-4.45	-4.45	-0.32%
합성선물 베이스(ATM)	0.14	-0.01	-0.01	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	95.2	37.8	132.9	0.9	-61.2	80.0	54.6	-7.5	-2.1	60.7
개인	-126.2	-18.1	-144.3	0.0	0.3	-67.0	-1.7	6.4	0.3	18.2
기관	51.0	-17.0	34.0	-10.2	-129.2	-9.1	-52.3	1.1	1.8	-82.0
금융투자	175.2	-0.5	174.7	0.0	-7.6	113.4	-51.0	1.0	1.9	-81.6
투신	-121.6	2.5	-119.2	0.0	-79.0	-138.5	-1.3	0.3	0.0	5.7
은행+보험+기타금융	-29.2	-16.5	-45.7	0.0	-27.9	7.0	0.0	-0.1	0.0	-0.9
연기금+국가자재	63.2	-1.6	61.6	-10.2	-8.2	9.1	0.0	0.0	0.0	-5.2
기타법인	-20.0	-2.6	-22.6	0.0	-0.2	-3.8	-0.6	-0.1	-0.1	3.1

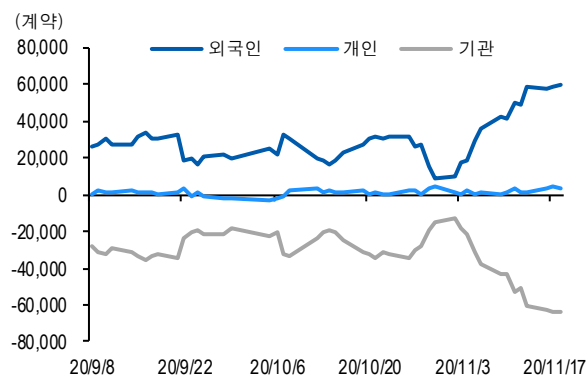
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



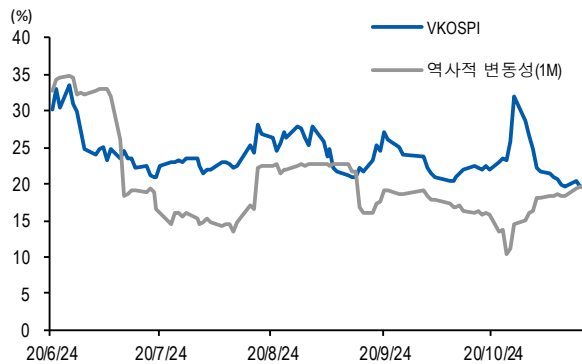
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	634,326	222.7	666,238	16.7%	지수옵션 전체	1,321,957	445.8	1,942,577
Put	687,631	223.1	1,276,339	18.4%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	19.63%(-0.09%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	2.80	-0.27	41,278	12,245	1,718	16.7	Put	342.5(K+1)	7.20	0.02	3,586	1,756	415	17.3
	345.0(K+2)	3.64	-0.27	29,766	11,632	-72	16.8		340.0(K+0)	5.92	-0.01	11,175	7,366	1,362	17.5
	342.5(K+1)	4.66	-0.29	14,141	11,172	1,817	16.9		337.5(K-1)	4.83	-0.02	13,107	5,437	626	17.8
	340.0(K+0)	5.87	-0.31	13,021	14,122	2,059	17.1		335.0(K-2)	3.92	-0.03	24,092	4,938	423	18.2
	337.5(K-1)	7.30	-0.30	3,652	5,893	259	17.4		332.5(K-3)	3.17	-0.04	23,469	5,250	781	18.6

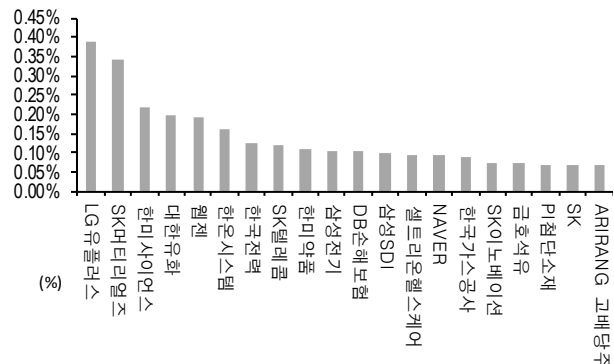
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,886,452	3,804.0	5,916,778	1,085	116,453	21,801	-144,369	60.7	18.2	-82.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	64,900	-1.37	1,496.0	100.5	1,382,921	-92,642	-0.01%	99,923	4,052	-106,016	-30,404	-262
SK 하이닉스	98,000	-0.20	331.1	90.6	268,731	16,779	0.03%	-5,900	-9,271	15,134	1,601	8,304
LG 화학	710,000	3.05	201.5	82.2	24,309	466	0.06%	-66	1,029	-1,001	-1,211	-399
LG 이노텍	151,500	-1.30	14.0	81.1	16,331	1,541	-0.86%	-2,808	563	2,246	1,280	513
LG 전자	88,800	4.72	138.1	74.4	66,843	28,454	-0.13%	1,994	6,502	-9,117	-16,049	-12,566
한국금융지주	75,400	-0.13	16.6	68.7	31,148	1,241	0.06%	652	125	-777	877	-1,656
카카오	366,000	0.97	120.4	68.0	29,540	-84	0.06%	472	-879	388	-327	-1,241
KB 금융	46,700	0.65	39.6	66.9	61,974	367	-0.23%	840	-9,886	9,054	7,361	4,717
삼성 SDI	499,500	0.91	122.9	63.5	21,733	698	0.10%	421	414	-867	-1,407	-461
삼성전기	149,500	-2.29	65.5	60.8	43,471	169	0.11%	-4,065	-747	4,785	3,373	3,290

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터