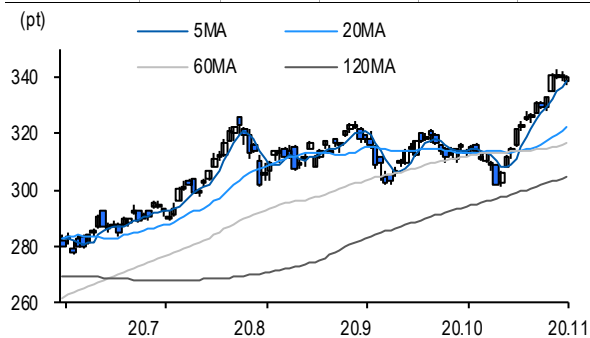


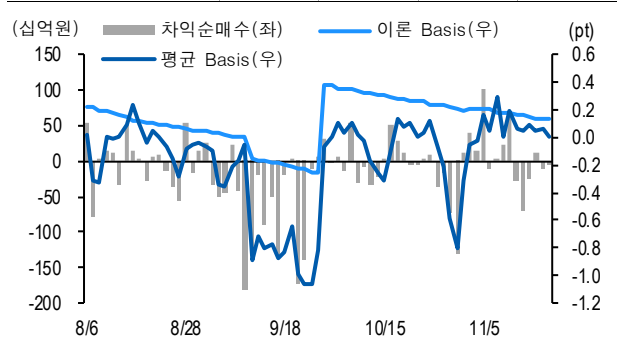
선물옵션시장 지표

2020.11.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	340.16	0.06	0.20	7,741.2	-
선물 12월물	340.25	0.09	0.30	20,414.2	270,494
선물 3월물	335.80	0.07	0.25	72.0	18,879
12월물(mini)	340.32	0.11	0.44	2,353.4	146,914
1월물(mini)	335.82	0.13	0.42	12.7	11,526



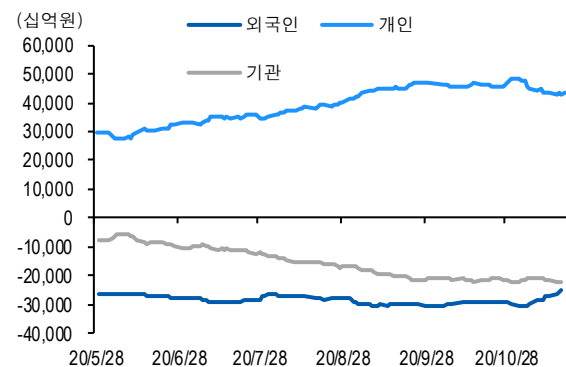
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.13	0.00	0.09	-0.04%
베이스(mini)	0.13	0.00	0.16	-0.04%
제1스프레드(SP)	-3.38	-4.47	-4.45	-0.32%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	0.09	0.09	-0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	106.2	39.6	145.8	-0.2	-108.5	121.6	-189.5	-2.2	-2.7	3.5
개인	201.9	-18.7	183.2	0.0	1.0	-28.7	-4.9	0.8	1.4	19.8
기관	-301.5	-21.1	-322.6	-5.1	-72.2	-99.1	193.0	1.5	1.3	-23.7
금융투자	-163.4	-44.8	-208.3	-3.4	-3.9	-84.4	195.0	1.5	1.2	-12.2
투신	-52.9	5.4	-47.5	0.0	-23.5	2.0	-2.0	0.0	0.1	-23.9
은행+보험+기타금융	-10.9	10.1	-0.8	0.0	-3.2	-4.1	0.0	0.0	0.0	3.5
연기금+국가자재	-42.7	6.1	-36.6	-1.7	-35.6	-12.5	0.0	0.0	0.0	8.9
기타법인	-6.5	0.1	-6.4	0.0	0.0	6.2	1.4	-0.1	0.0	0.5

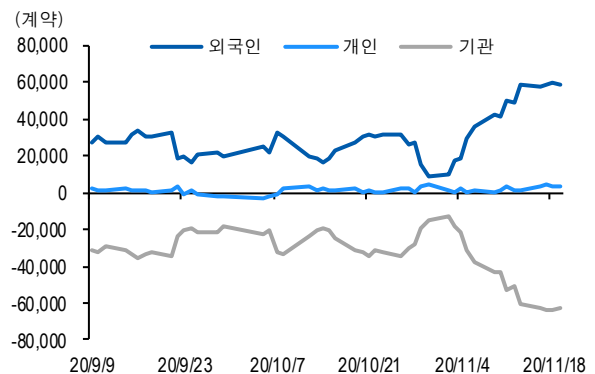
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



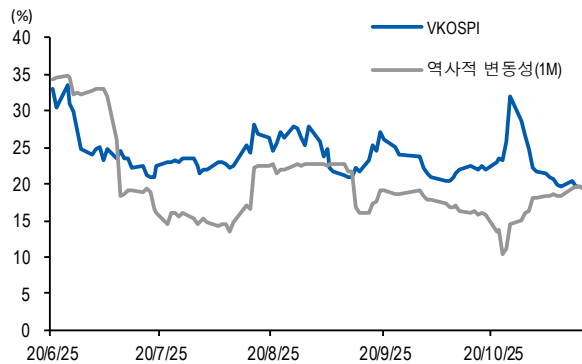
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	622,263	202.7	689,683	16.4%	지수옵션 전체	1,346,229	464.6	2,001,250
Put	723,966	261.9	1,311,567	18.0%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	19.41%(-0.22%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	2.65	-0.15	50,661	13,683	1,438	16.4	Put	342.5(K+1)	6.76	-0.44	3,454	1,940	184	16.7
	345.0(K+2)	3.50	-0.14	40,462	12,592	960	16.5		340.0(K+0)	5.50	-0.42	8,342	7,697	331	17.0
	342.5(K+1)	4.53	-0.13	18,784	11,233	61	16.6		337.5(K-1)	4.44	-0.39	12,169	5,690	253	17.3
	340.0(K+0)	5.75	-0.12	11,862	13,993	-129	16.8		335.0(K-2)	3.56	-0.36	20,451	6,010	1,072	17.6
	337.5(K-1)	7.19	-0.11	6,294	6,615	722	17.1		332.5(K-3)	2.87	-0.30	30,427	5,790	540	18.1

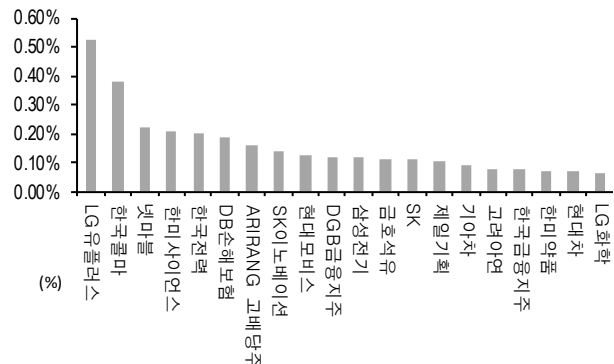
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,117,851	2,955.8	5,965,660	48,882	24,150	28,820	-56,490	3.5	19.8	-23.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	64,700	-0.31	1,011.4	95.4	1,399,502	16,581	0.04%	16,616	24,647	-42,088	-18,996	205
SK 하이닉스	98,300	0.31	249.7	92.8	254,713	-14,018	0.01%	1,983	5,817	-7,772	194	8,090
카카오	363,500	-0.68	112.9	71.6	30,430	890	0.06%	-843	-175	997	-6	-629
LG 화학	720,000	1.41	178.6	69.8	26,195	1,886	0.07%	-1,230	359	881	-288	-257
현대차	180,000	0.00	168.2	68.2	80,233	-2,444	0.07%	2,971	-930	-2,043	-8	-558
삼성전기	150,500	0.67	48.0	67.8	43,565	94	0.12%	3,811	-530	-3,286	-1,360	-1,926
한화솔루션	49,600	-0.60	78.9	64.7	94,587	1,996	0.01%	-7,589	738	6,853	-3,832	5,357
LG 전자	89,000	0.23	68.0	62.4	61,574	-5,269	-0.21%	-4,486	-2,835	7,416	237	7,113
기아차	58,800	0.68	60.9	59.9	163,880	-2,232	0.09%	-3,544	-1,422	4,967	-3,285	4,813
롯데케미칼	282,000	-0.18	41.0	56.2	10,321	1,182	0.01%	-379	-222	472	602	-481

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터