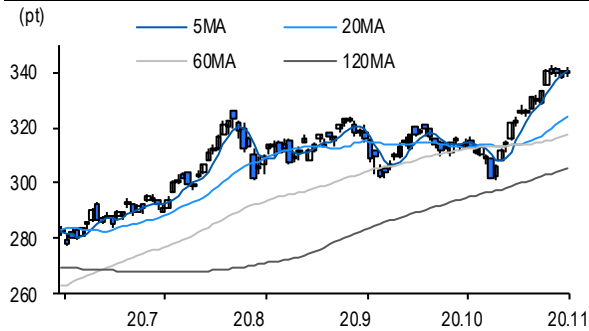


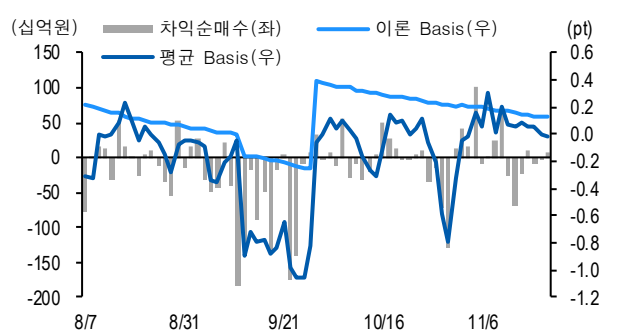
선물옵션시장 지표

2020.11.23

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	340.62	0.14	0.46	6,982.9	-	
선물 12월물	340.30	0.01	0.05	21,739.1	269,321	
선물 3월물	335.80	0.00	0.00	54.9	18,891	
12월물(mini)	340.30	0.01	-0.02	2,511.7	154,240	
1월물(mini)	335.94	0.04	0.12	18.7	11,840	

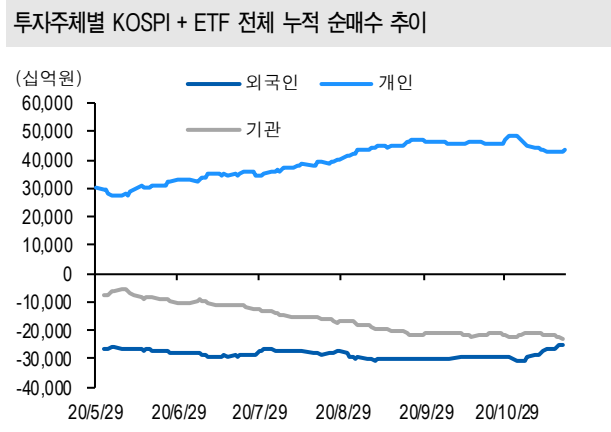


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.12	-0.02	-0.32	-0.04%	
베이스(mini)	0.12	-0.02	-0.32	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-3.38	-4.48	-4.50	-0.32%	
합성선물 베이스(ATM)	0.12	-0.34	-0.34	-0.14%	

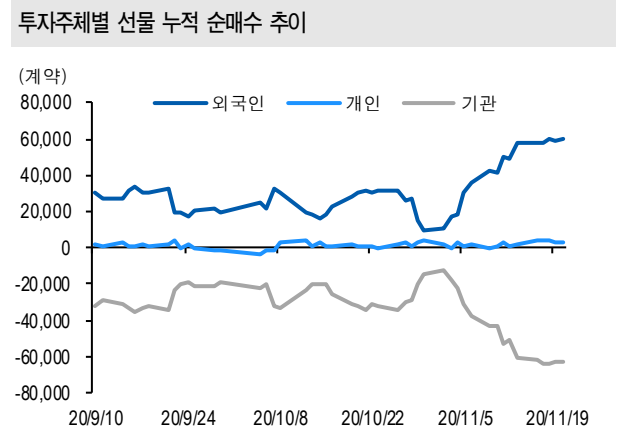


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	103.4	25.2	128.6	0.7	-2.9	126.5	-60.8	-0.2	0.9	-4.6	
개인	122.6	-43.6	79.0	0.0	0.7	-59.6	-2.5	0.2	-0.2	27.9	
기관	-230.8	19.4	-211.4	7.7	-150.7	-69.0	63.7	0.3	-0.2	-20.9	
금융투자	-39.0	8.0	-31.0	0.0	-15.0	-9.4	64.1	0.0	0.1	-24.2	
투신	-124.9	22.1	-102.8	0.0	-90.6	-43.5	-0.4	0.3	-0.1	1.3	
은행+보험+기타금융	-42.7	-3.3	-46.0	-0.9	-30.5	-7.0	0.0	0.0	-0.2	-0.4	
연기금+국가자재	-17.5	-0.9	-18.3	8.7	-7.0	-9.1	0.0	0.0	0.0	2.4	
기타법인	4.8	-1.1	3.8	0.0	-0.1	2.1	-0.4	-0.2	-0.5	-2.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

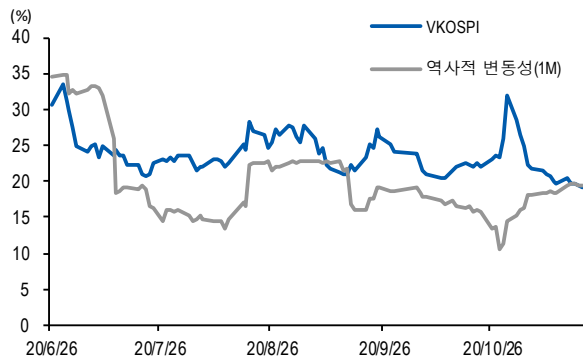
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	718,537	246.8	709,995	15.5%	지수옵션 전체	1,526,782	497.5	2,064,581
Put	808,245	250.8	1,354,586	18.2%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	19.21%(-0.20%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	2.41	-0.24	65,883	14,627	944	15.5	Put	342.5(K+1)	6.50	-0.26	4,182	2,152	212	17.1
	345.0(K+2)	3.25	-0.25	50,948	13,946	1,354	15.5		340.0(K+0)	5.25	-0.25	15,646	8,699	1,002	17.3
	342.5(K+1)	4.28	-0.25	19,799	11,518	285	15.6		337.5(K-1)	4.21	-0.23	16,434	6,868	1,178	17.5
	340.0(K+0)	5.53	-0.22	11,552	13,795	-198	15.8		335.0(K-2)	3.35	-0.21	33,611	6,602	592	17.9
	337.5(K-1)	7.00	-0.19	4,468	6,432	-183	16.1		332.5(K-3)	2.67	-0.20	32,448	6,744	954	18.3

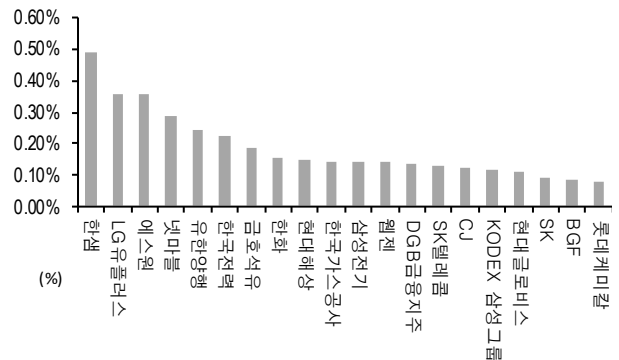
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,629,467	2,537.8	6,024,240	58,580	37,843	79,551	-118,565	-4.6	27.9	-20.9

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	0.00	1,083.3	112.8	1,379,149	-20,353	0.05%	-6,203	1,877	7,931	-8,733	19,746
SK 하이닉스	97,000	-1.32	222.2	94.4	253,391	-1,322	0.04%	-5,796	11,387	-5,500	-687	-2,454
LG 전자	88,400	-0.67	40.7	78.1	58,131	-3,443	-0.32%	-322	1,250	-919	2,028	1,752
롯데케미칼	288,500	2.30	48.6	69.3	12,596	2,275	0.08%	-627	924	-303	-643	-1,653
LG 화학	723,000	0.42	131.0	64.8	25,965	-230	0.06%	-666	-240	915	475	208
한국금융지주	74,800	0.81	12.9	61.2	31,356	225	0.04%	82	-10	-27	560	-589
현대차	177,000	-1.67	131.4	58.5	77,740	-2,493	0.00%	-674	299	313	-1,821	3,739
카카오	365,500	0.55	54.4	56.3	30,303	-127	0.00%	-72	-234	257	205	52
하나금융지주	35,400	-1.12	20.5	44.0	93,941	1,451	-0.01%	1,634	2,562	-4,201	-1,501	-2,730
기아차	57,900	-1.53	47.8	43.6	173,039	9,159	0.03%	-4,277	243	4,134	7,779	-3,723

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터