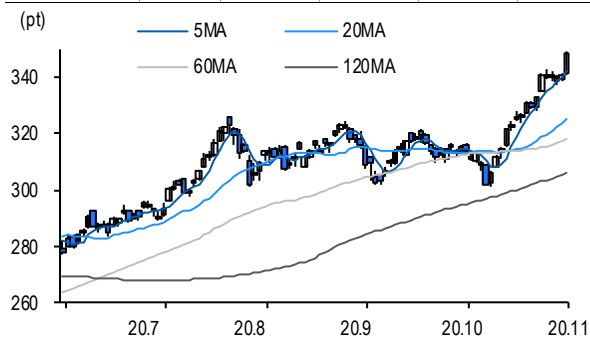


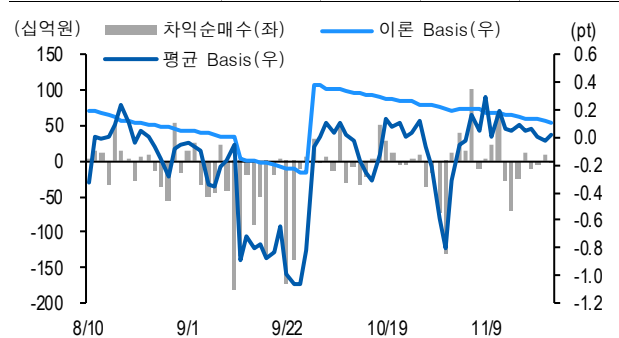
선물옵션시장 지표

2020.11.24

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.46	2.30	7.84	9,562.0	-
선물 12월물	348.50	2.41	8.20	21,722.1	271,564
선물 3월물	343.95	2.43	8.15	112.1	19,486
12월물(mini)	348.50	2.41	8.20	2,325.6	161,333
1월물(mini)	343.88	2.36	7.94	18.1	11,858



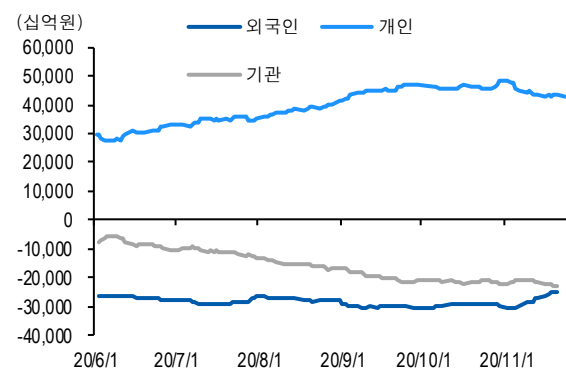
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.11	0.02	0.04	-0.03%
베이스(mini)	0.11	0.02	0.04	-0.03%
제1스프레드(SP)	-3.36	-4.48	-4.50	-0.32%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	-0.05	-0.05	-0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	983.4	57.8	1,041.2	10.5	495.4	149.3	-22.3	6.5	-1.5	-14.8
개인	-873.7	48.7	-825.0	0.0	-1.2	-90.5	-32.7	-0.4	-2.1	61.3
기관	-59.9	-109.0	-168.9	-13.8	-143.2	-80.4	56.8	-6.4	3.7	-47.2
금융투자	15.5	81.5	97.0	0.0	0.5	-449.5	56.2	-7.4	3.8	-100.6
투신	-56.0	1.0	-54.9	0.0	-67.0	342.2	0.7	0.9	0.0	91.5
은행+보험+기타금융	-65.0	-189.3	-254.3	0.0	-49.4	17.9	0.0	0.1	0.0	3.1
연기금+국가지자체	39.1	-9.3	29.8	-13.8	-9.6	8.9	-0.1	0.0	0.0	-41.2
기타법인	-49.8	2.5	-47.3	0.0	-0.8	21.6	-1.8	0.3	-0.2	0.8

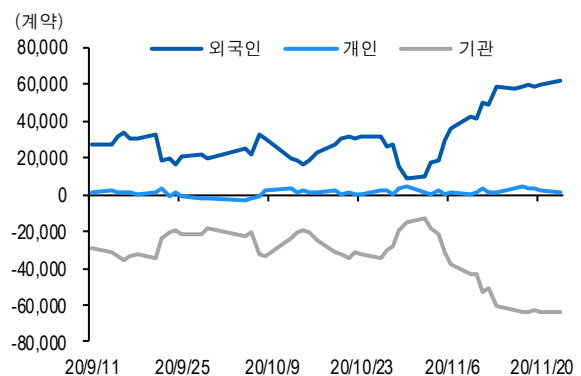
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



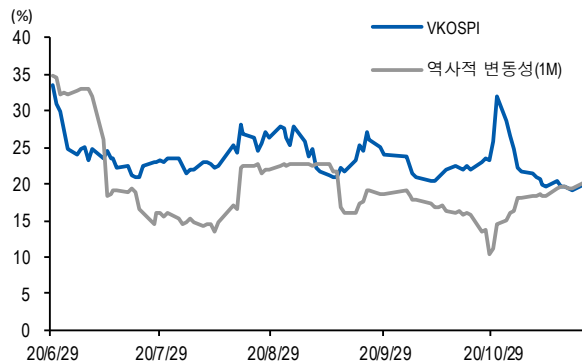
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,311,157	526.7	726,754	17.7%	지수옵션 전체	2,342,843	790.1	2,155,397
Put	1,031,686	263.4	1,428,643	20.3%	PCR(금액기준)	0.50	VKOSPI	19.79%(+0.58%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	6.04	3.63	51,776	13,991	-636	17.8	Put	342.5(K+1)	3.23	-3.27	19,476	3,710	1,558	18.8
	345.0(K+2)	7.51	4.26	20,744	13,842	-104	18.0		340.0(K+0)	2.54	-2.71	35,509	9,464	765	19.2
	342.5(K+1)	9.17	4.89	9,683	10,959	-559	18.4		337.5(K-1)	2.00	-2.21	42,485	10,164	3,296	19.7
	340.0(K+0)	10.95	5.42	5,427	12,002	-1,793	18.6		335.0(K-2)	1.58	-1.77	50,937	9,239	2,637	20.2
	337.5(K-1)	12.90	5.90	1,852	6,041	-391	18.9		332.5(K-3)	1.26	-1.41	57,711	10,634	3,890	20.8

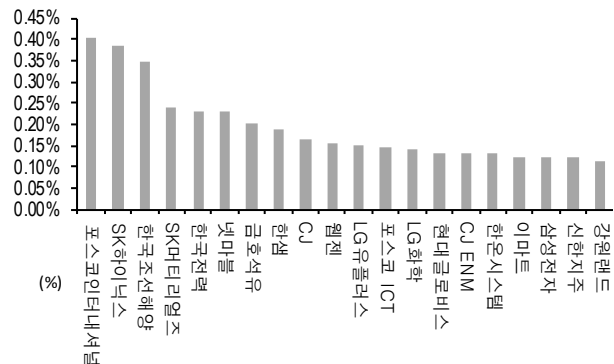
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,694,134	3,320.8	6,371,602	347,362	-1,965	24,041	-32,511	-14.8	61.3	-47.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	67,600	4.48	1,431.4	80.0	1,516,199	137,050	0.12%	13,926	23,312	-37,851	-88,435	-30,763
LG 전자	89,200	0.90	50.3	76.1	53,576	-4,555	-0.28%	-1,108	3,739	-2,697	1,006	1,046
기아차	59,400	2.59	79.2	65.6	167,671	-5,368	0.02%	-16,101	4,948	11,051	-6,294	14,299
롯데케미칼	290,500	0.69	44.6	63.8	13,065	469	0.03%	-752	30	723	681	-342
현대차	180,000	1.69	164.8	62.9	79,479	1,739	0.03%	697	4,260	-4,999	-2,043	-76
LG 화학	748,000	3.46	195.8	56.6	28,349	2,384	0.14%	511	-89	-437	-417	-2,355
삼성전기	152,000	2.01	51.8	55.4	43,548	1,832	-0.07%	-1,117	2,979	-1,864	-2,867	1,110
한국금융지주	76,300	2.01	18.2	49.3	33,082	1,726	0.09%	295	567	-871	-1,340	-777
SK 하이닉스	101,000	4.12	201.0	48.8	284,885	31,494	0.39%	4,482	14,167	-18,788	-7,426	-22,354
KB 금융	46,450	1.53	31.5	44.2	63,932	-2,658	0.01%	1,529	3,587	-5,188	-1,597	-549

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터