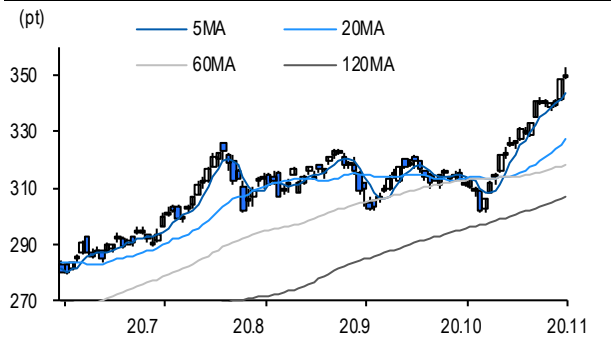
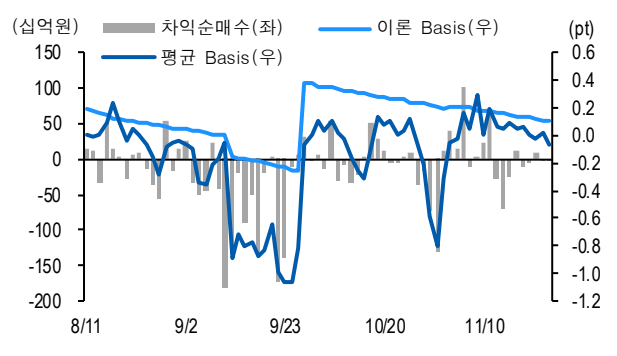


선물옵션시장 지표 2020.11.25

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	350.28	0.52	1.82	11,114.8	-
선물 12월물	350.00	0.43	1.50	25,819.6	270,159
선물 3월물	345.80	0.54	1.85	162.1	20,059
12월물(mini)	350.22	0.49	1.72	3,285.7	176,277
1월물(mini)	345.90	0.59	2.02	37.4	13,407

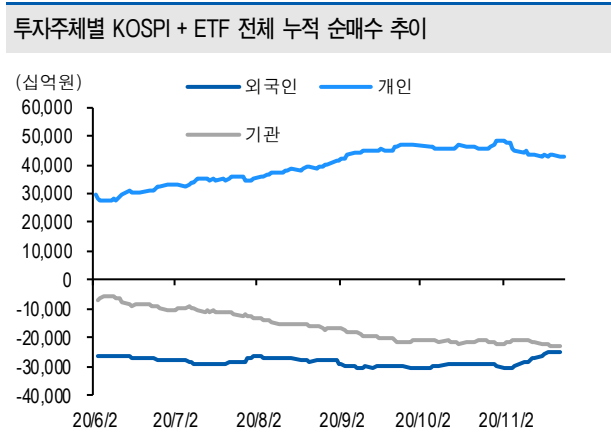


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.10	-0.07	-0.28	-0.05%
베이스스(mini)	0.10	-0.06	-0.06	-0.05%
제1스프레드(SP)	-3.36	-4.48	-4.50	-0.32%
합성선물 베이스스(ATM)	0.10	-0.29	-0.29	-0.11%

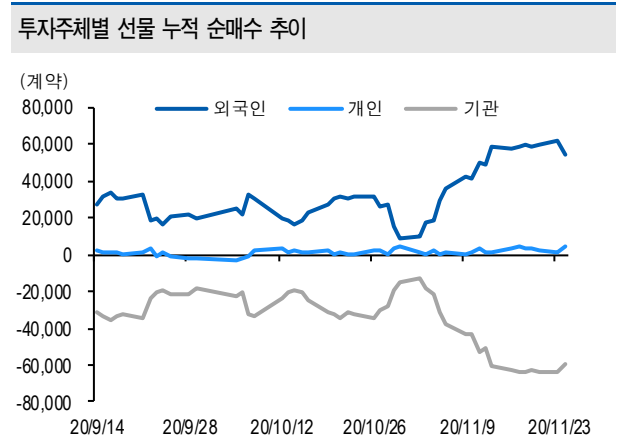


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	726.1	22.4	748.5	0.2	410.5	-353.0	-288.0	4.4	2.3	-38.2
개인	-23.3	22.6	-0.7	0.0	-0.6	283.3	14.4	-3.6	-3.8	-25.1
기관	-694.1	-50.8	-744.9	-3.4	-385.1	72.3	267.2	-1.5	1.9	66.0
금융투자	-243.5	120.3	-123.1	-1.8	-42.9	313.8	266.9	-1.9	1.4	-3.2
투신	-102.6	-31.4	-134.0	-5.2	-77.2	-219.1	0.3	0.4	-0.1	62.0
은행+보험+기타금융	-59.8	-178.0	-237.8	0.0	-42.4	17.4	0.0	0.0	0.6	3.4
연기금+국가자재	-213.8	9.4	-204.4	3.6	-167.5	-39.8	0.0	0.0	0.0	3.8
기타법인	-8.7	5.9	-2.9	0.0	-1.0	-2.6	6.4	0.6	-0.4	-2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





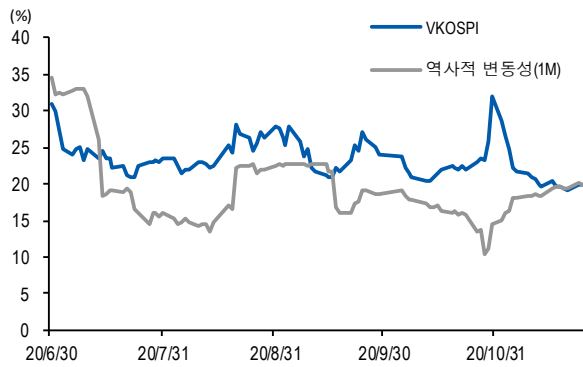
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,172,739	457.0	743,936	17.2%	지수옵션 전체	2,290,347	760.9	2,238,613
Put	1,117,608	304.0	1,494,677	19.4%	PCR(금액기준)	0.67	VKOSPI	19.81%(+0.02%p)

	Call				Put									
	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	355.0(K+3)	3.24	0.46	72,579	15,048	2	17.2	350.0(K+1)	5.38	-0.87	17,065	9,799	2,654	18.5
	352.5(K+2)	4.19	0.54	24,011	11,135	1,228	17.1	347.5(K+0)	4.25	-0.82	28,272	6,799	3,229	18.6
	350.0(K+1)	5.36	0.64	33,531	23,953	-524	17.1	345.0(K-1)	3.33	-0.70	37,830	5,678	966	18.8
	347.5(K+0)	6.74	0.70	11,464	13,521	-470	17.2	342.5(K-2)	2.62	-0.61	57,581	7,191	3,481	19.2
	345.0(K-1)	8.33	0.82	7,816	13,388	-454	17.4	340.0(K-3)	2.04	-0.50	79,358	11,809	2,345	19.6

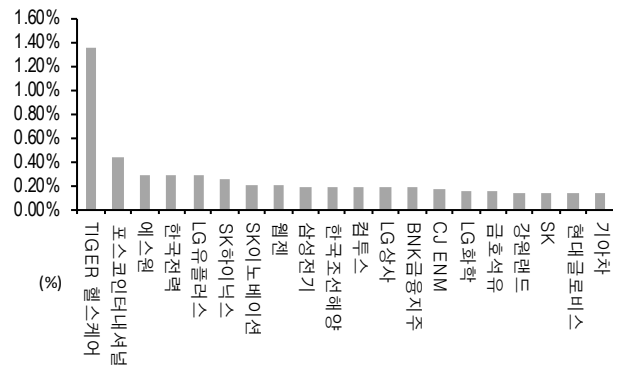
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,665,594	3,993.9	6,420,196	48,594	-60,831	-11,433	71,170	-38.2	-25.1	66.0

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	0.00	1,620.4	74.4	1,502,217	-13,982	0.07%	-4,675	-46,509	52,300	14,403	22,261
SK 하이닉스	98,800	-2.18	252.6	67.4	284,285	-600	0.25%	-6,900	-5,482	13,425	1,216	5,653
LG 화학	799,000	6.82	402.0	60.1	33,300	4,951	0.16%	-1,842	-334	2,147	190	-1,516
대한유화	245,000	-2.97	12.8	58.0	7,583	-1,086	0.09%	-57	-848	1,337	215	694
롯데케미칼	289,000	-0.52	45.9	57.8	12,636	-429	0.02%	-438	-893	1,310	397	1,223
현대차	181,000	0.56	147.8	54.2	79,842	363	-0.01%	-2,243	2,536	-343	51	259
기아차	59,900	0.84	59.1	49.4	171,092	3,421	0.13%	-4,334	-939	5,033	990	1,803
KB 금융	46,300	-0.32	33.4	48.9	53,873	-10,059	-0.03%	-1,324	3,129	-1,805	2,079	6,344
카카오	373,500	1.49	116.5	48.2	30,564	1,386	0.07%	-631	508	106	461	-1,376
하나금융지주	35,550	-0.70	22.7	47.4	96,091	3,195	0.04%	-2,409	1,707	61	-32	-1,055

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터