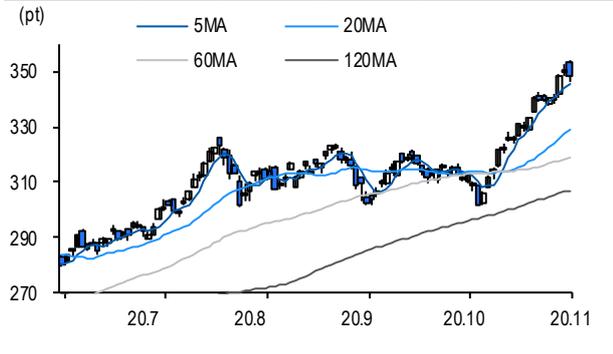


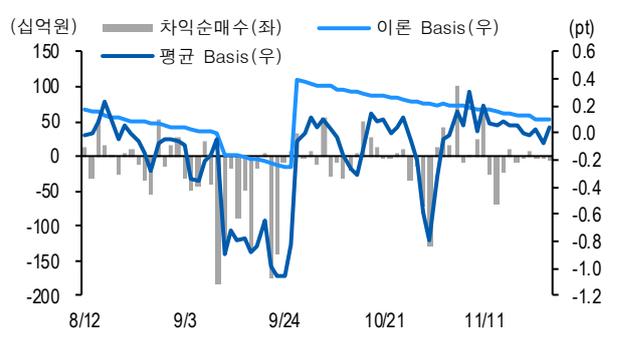


선물옵션시장 지표 2020.11.26

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.30	-0.57	-1.98	15,910.2	-
선물 12월물	348.10	-0.54	-1.90	31,645.5	273,620
선물 3월물	343.85	-0.56	-1.95	217.3	20,371
12월물(mini)	348.12	-0.54	-2.10	3,675.9	173,536
1월물(mini)	343.64	-0.65	-2.26	30.4	13,407

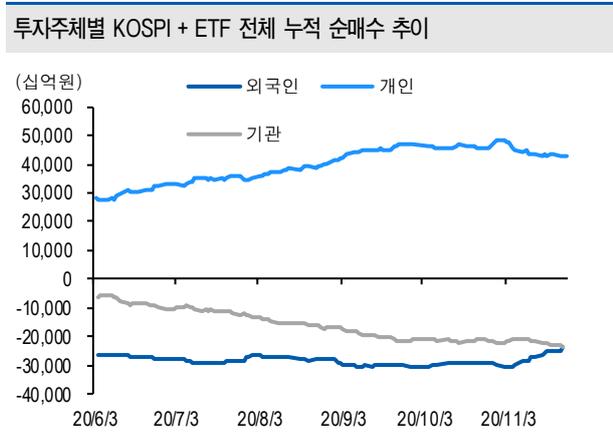


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.09	0.04	-0.20	-0.02%
베이스(mini)	0.09	0.04	-0.18	-0.02%
제1스프레드(SP)	-3.36	-4.56	-4.55	-0.35%
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.16	-0.16	-0.07%

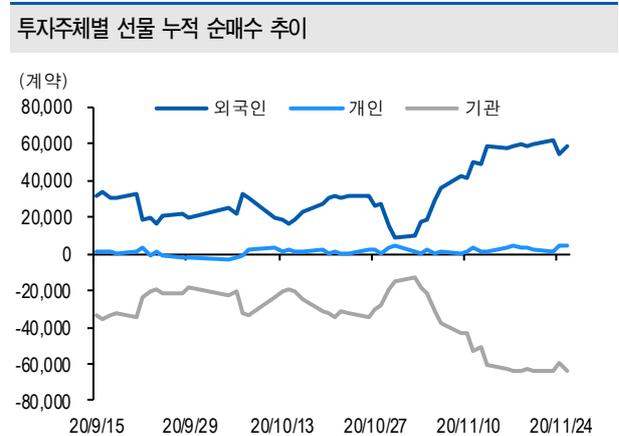


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	134.6	-11.8	122.8	0.7	245.5	293.0	115.8	-3.1	0.2	25.9
개인	505.7	37.6	543.3	0.0	12.0	-42.5	23.1	1.4	0.2	36.9
기관	-617.9	-7.9	-625.8	-7.2	-363.5	-252.2	-143.8	1.9	-0.8	-68.3
금융투자	-24.3	112.4	88.1	-3.5	-31.2	-0.3	-145.6	1.0	-0.1	-9.8
투신	-198.1	-15.7	-213.8	0.0	-116.6	-294.2	1.6	0.9	-0.1	-100.6
은행+보험+기타금융	-56.6	-108.4	-164.9	0.0	-40.8	-0.1	0.0	0.0	-0.6	-1.2
연기금+국가자재	-258.9	3.2	-255.8	-3.7	-143.9	42.4	0.1	0.0	0.0	43.3
기타법인	-22.5	-17.9	-40.3	0.0	0.9	1.7	4.8	-0.1	0.5	5.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





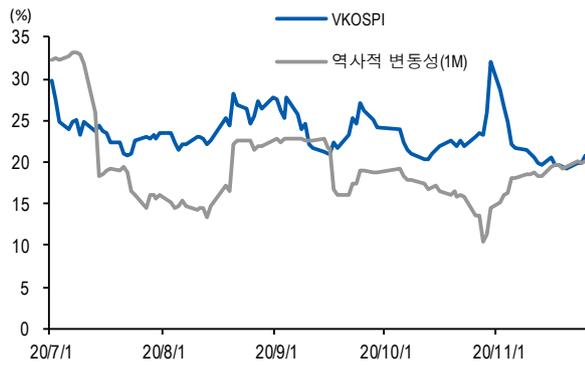
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,119,040	374.8	763,917	18.1%	지수옵션 전체	2,463,441	781.6	2,318,310			
Put	1,344,401	406.8	1,554,393	19.7%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	20.82%(+1.01%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	1.98	-0.47	67,086	10,778	1,500	18.1	Put	352.5(K+1)	3.49	-0.70	22,798	9,151	-1,984	18.1
	355.0(K+2)	2.65	-0.59	43,379	13,879	-1,169	18.1		350.0(K+0)	6.39	1.01	23,981	10,476	677	19.0
	350.0(K+0)	4.53	-0.83	25,170	23,420	-533	18.1		347.5(K-1)	5.14	0.89	28,940	7,750	951	19.2
	347.5(K-1)	5.79	-0.95	4,708	13,129	-392	18.3		345.0(K-2)	4.12	0.79	57,255	7,860	2,182	19.5
										342.5(K-3)	3.26	0.64	79,034	8,028	837

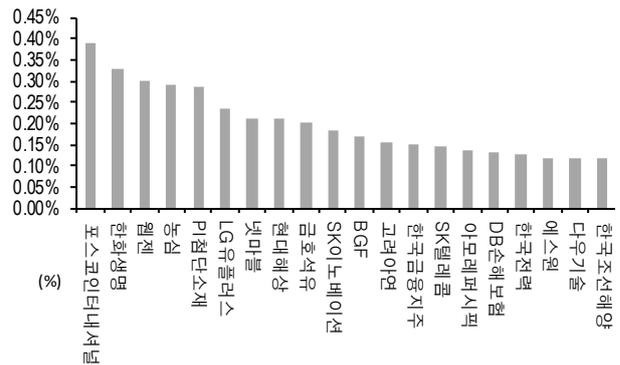
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,981,663	6,434.7	6,428,148	7,952	81,526	73,214	-162,648	25.9	36.9	-68.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	66,600	-1.48	1,685.9	83.8	1,420,121	-82,096	0.02%	44,991	35,359	-80,244	-8,452	1,482
LG 화학	791,000	-1.00	488.3	77.9	30,816	-2,484	0.09%	-1,346	64	1,321	174	2,820
삼성전기	150,500	-0.33	139.6	73.5	38,733	-6,110	0.01%	-2,571	-263	2,487	-158	6,379
현대차	180,500	-0.28	240.5	63.8	77,069	-2,773	0.02%	1,783	-2,414	916	1,585	592
기아차	58,900	-1.67	67.9	58.7	178,707	7,615	0.09%	701	3,234	-4,369	127	-9,478
KB 금융	48,100	3.89	87.3	56.8	66,497	12,624	0.05%	7,943	384	-11,938	-7,367	-8,079
롯데케미칼	281,000	-2.77	49.5	54.3	11,907	-729	0.03%	-79	866	-781	159	358
POSCO	244,000	0.00	50.7	53.0	13,668	-760	-0.12%	-153	-8	161	-78	787
삼성 SDI	537,000	-2.19	213.3	51.6	19,874	-1,493	-0.05%	-3,790	755	2,417	3,406	1,787
SK 이노베이션	164,000	2.18	180.3	49.5	58,068	8,636	0.18%	-2,021	4,681	-2,770	-3,861	-4,931

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

