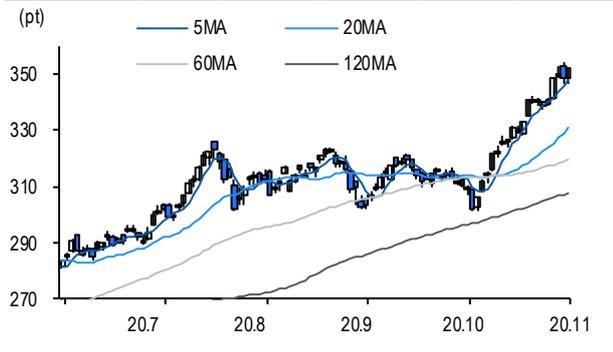
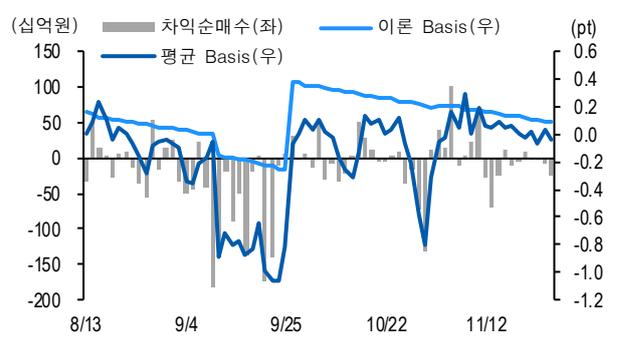


선물옵션시장 지표 2020.11.27

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	352.12	1.10	3.82	8,737.7	-
선물 12월물	351.95	1.11	3.85	23,655.6	271,236
선물 3월물	347.35	1.02	3.50	131.7	20,713
12월물(mini)	352.00	1.12	3.88	2,181.1	182,580
1월물(mini)	347.18	1.03	3.54	38.2	14,197

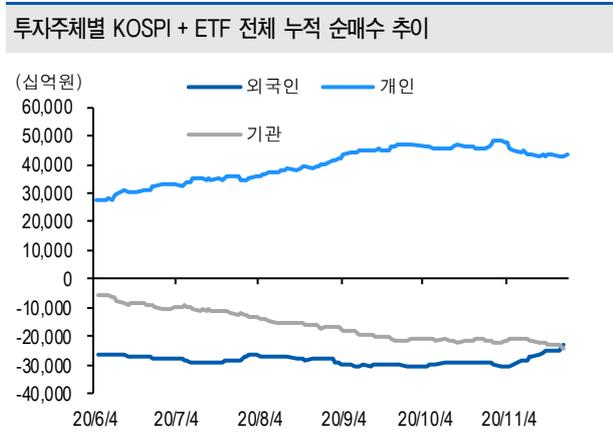


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.09	-0.04	-0.17	-0.04%	
베이스(mini)	0.09	-0.04	-0.12	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-3.36	-4.60	-4.60	-0.35%	
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.24	-0.24	-0.09%	

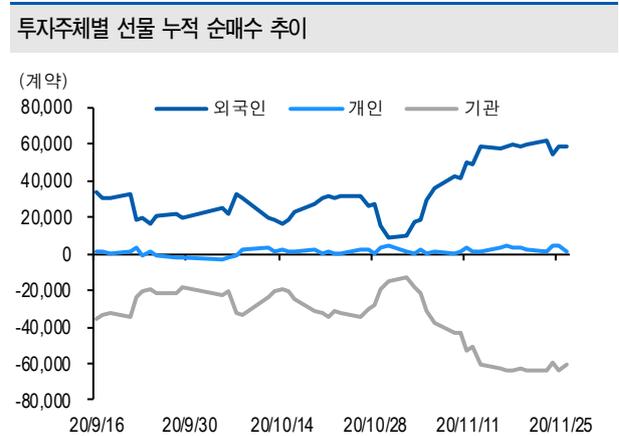


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	253.9	16.0	269.9	0.0	67.0	152.6	-172.7	2.0	-4.8	-36.1
개인	257.9	-20.7	237.1	0.0	-0.4	-228.5	-27.1	-2.6	2.6	-5.5
기관	-527.8	-3.9	-531.7	-24.3	-289.2	78.9	202.6	0.8	2.2	42.5
금융투자	-192.9	-24.0	-216.9	0.0	-31.0	8.6	202.8	0.1	1.8	16.1
투신	-139.9	-12.0	-151.9	0.0	-102.6	42.6	-0.2	0.7	0.2	54.2
은행+보험+기타금융	-9.7	40.1	30.4	0.0	-4.9	12.6	0.0	-0.1	0.3	0.5
연기금+국가자재	-168.6	6.0	-162.6	-24.3	-118.5	15.1	0.0	0.0	0.0	-28.4
기타법인	16.0	8.6	24.6	0.0	0.0	-2.9	-2.8	-0.2	0.0	-0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

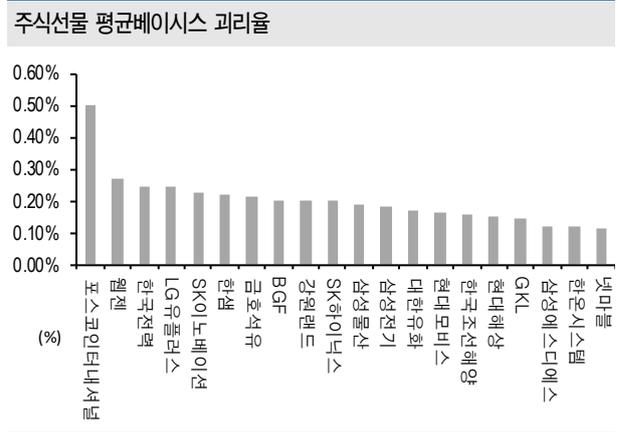
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	983,534	331.9	784,655	16.8%	지수옵션 전체	1,883,379	579.3	2,379,237
Put	899,845	247.4	1,594,582	19.6%	PCR(금액기준)	0.75	VKOSPI	20.00%(-0.82%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	355.0(K+3)	3.53	0.88	78,091	13,133	-746	16.8	Put	350.0(K+1)	4.14	-2.25	11,025	10,973	497	18.2
	352.5(K+2)	4.68	1.19	33,318	9,530	379	16.9		347.5(K+0)	3.23	-1.91	21,353	8,986	1,236	18.6
	350.0(K+1)	6.03	1.50	34,433	24,109	689	17.1		345.0(K-1)	2.51	-1.61	34,434	8,131	271	19.0
	347.5(K+0)	7.61	1.82	8,380	12,492	-637	17.3		342.5(K-2)	1.94	-1.32	37,065	9,546	1,518	19.5
	345.0(K-1)	9.34	2.10	3,894	13,106	158	17.4		340.0(K-3)	1.51	-1.04	61,469	15,637	2,222	20.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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)	금융투자	연기금등		
주식선물 전체	4,474,691	3,832.8	6,568,925	140,777	-56,358	17,829	39,019	-36.1	-5.5	42.5				
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수		
삼성전자	68,000	2.10	1,220.1	95.6	1,417,310	-2,811	0.06%	4,341	-23,532	20,434	11,264	345		
롯데케미칼	290,000	3.20	56.7	90.3	15,094	3,187	0.09%	1,318	99	-1,429	322	-3,157		
현대차	179,000	-0.83	157.7	70.2	77,119	50	0.08%	-2,691	2,448	384	-216	829		
LG 화학	816,000	3.16	310.9	69.9	31,671	855	0.02%	-3,460	-433	3,866	1,606	1,513		
하나금융지주	36,200	0.00	27.9	67.0	101,289	-7,870	0.04%	-2,164	-6,105	8,269	1,733	5,620		
현대모비스	247,000	0.00	47.2	60.3	15,856	-169	0.16%	-881	-71	952	-217	802		
SK 하이닉스	99,600	2.36	170.5	59.3	283,970	15,256	0.20%	-2,441	8,897	-6,606	2,422	-12,361		
KB 금융	48,400	0.62	53.1	56.4	66,073	-424	0.04%	-5,391	3,885	1,616	-1,089	2,047		
기아차	58,500	-0.68	53.1	54.0	180,787	2,080	0.05%	-3,903	-1,062	5,308	1,339	2,172		
대림산업	83,900	-0.94	13.0	52.1	24,594	-835	0.05%	-390	-227	617	-28	643		

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터