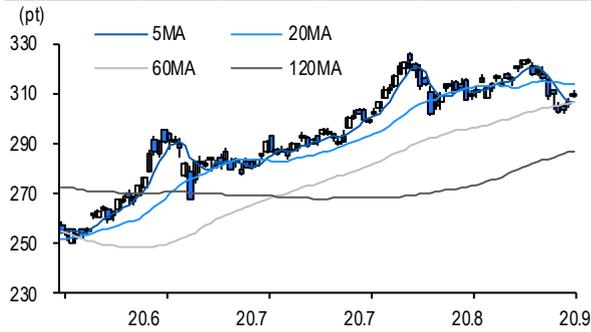


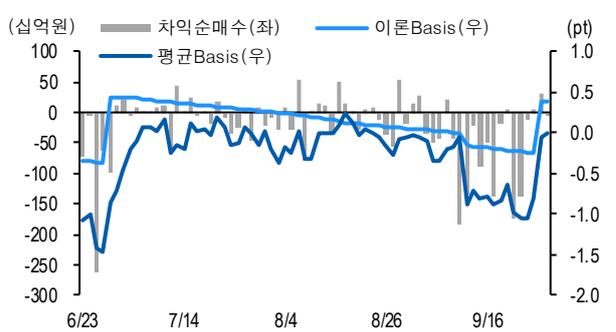
선물옵션시장 지표

2020.10.5

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.44	0.78	2.41	5,604.3	-
선물 12월물	309.95	0.75	2.30	20,409.4	275,434
선물 3월물	306.55	0.76	2.30	20.5	4,281
10월물(mini)	309.84	0.75	2.30	2,352.8	105,500
11월물(mini)	309.64	0.75	2.32	18.0	7,578

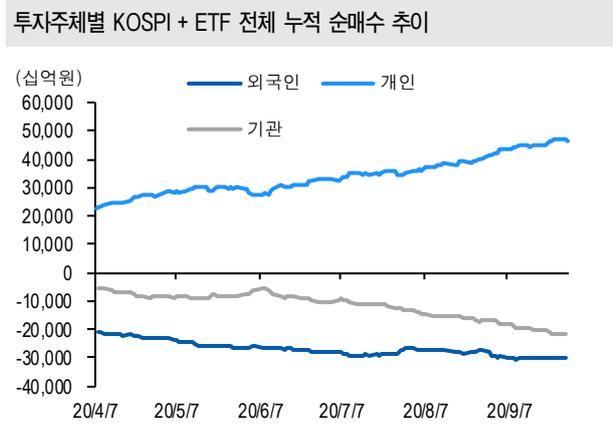


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.38	0.00	0.51	-0.12%	
베이스(mini)	0.05	-0.03	0.40	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.46	-3.26	-3.30	0.06%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.28	0.28	0.07%	

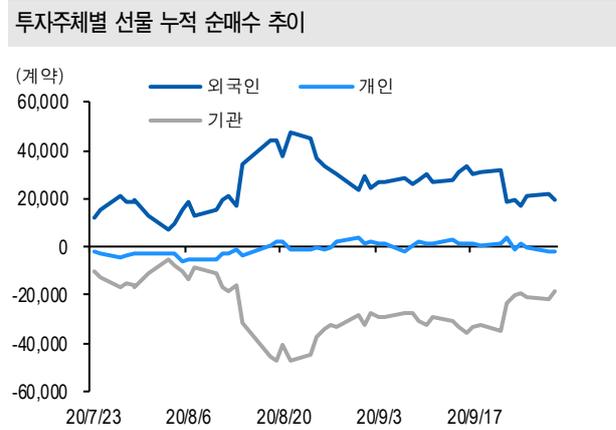


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-73.6	115.1	41.5	0.0	-58.5	-314.8	117.2	4.6	0.5	23.6	
개인	-61.6	-79.9	-141.4	0.0	1.3	6.5	-11.7	-1.0	-0.7	-36.5	
기관	141.5	-34.4	107.1	-2.9	24.7	308.4	-105.2	-4.3	-0.1	14.6	
금융투자	201.0	-73.8	127.1	0.0	1.6	176.5	-104.7	-4.1	-0.4	-17.0	
투신	37.6	32.4	70.0	0.0	5.3	102.2	-0.6	-0.2	0.3	18.6	
은행+보험+기타금융	31.5	11.9	43.5	-1.5	6.0	24.8	0.0	0.0	0.0	1.4	
연기금+국가자재	-154.3	-4.0	-158.3	-1.4	10.3	4.9	0.0	0.0	0.0	11.6	
기타법인	-6.3	-0.9	-7.1	0.0	0.0	-0.1	-0.2	0.6	0.3	-1.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	856,923	260.0	820,942	17.7%	지수옵션 전체	1,726,507	488.1	2,087,524			
Put	869,584	228.2	1,266,582	20.6%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	24.15%(-0.86%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	1.50	0.27	138,640	24,277	-651	17.5	Put	310.0(K+1)	3.91	-1.50	24,850	16,300	947	17.9
	312.5(K+2)	2.41	0.41	93,051	12,866	604	18.1		307.5(K+0)	2.92	-1.24	39,718	7,794	864	18.8
	310.0(K+1)	3.61	0.60	56,023	15,511	-1,175	18.9		305.0(K-1)	2.15	-1.02	79,302	19,104	1,367	19.7
	307.5(K+0)	5.14	0.87	7,856	6,488	-405	20.0		302.5(K-2)	1.55	-0.85	72,425	11,432	1,320	20.5
	305.0(K-1)	6.86	1.10	3,215	4,906	-370	20.9		300.0(K-3)	1.17	-0.64	97,087	25,376	34	21.7

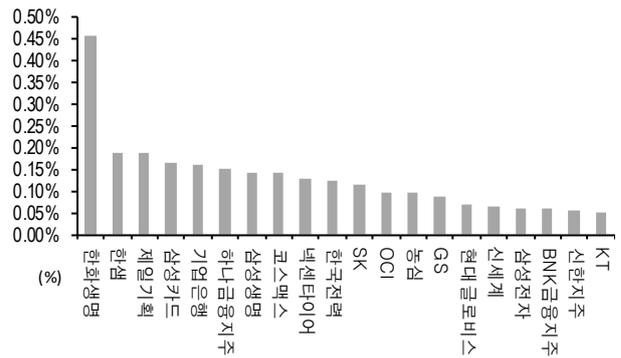
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,157,483	2,311.9	5,996,899	19,601	36,564	-39,979	8,165	23.6	-36.5	14.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	76,200	0.40	24.9	82.6	30,836	-9,002	-0.11%	432	-4,398	5,767	1,646	7,202
기아차	47,050	3.18	55.7	74.4	94,496	7,335	0.00%	-4,466	-1,496	5,962	8,914	-6,050
삼성 SDI	435,000	3.08	84.2	72.8	15,828	-144	-0.01%	-1,204	-373	1,487	440	241
삼성전자	58,500	0.52	574.9	72.5	1,226,367	-77,960	0.06%	29,968	-19,917	-6,361	-21,450	18,413
삼성전기	138,500	-0.72	36.7	60.7	33,865	1,425	0.02%	-263	-41	408	973	-920
한화솔루션	38,450	0.92	103.4	58.8	63,712	-10,397	-0.01%	-16,904	-1,202	18,145	8,857	9,066
LG 화학	653,000	3.98	249.2	58.4	35,058	-1,871	0.05%	1,203	-992	-199	-736	82
SK 하이닉스	84,000	1.82	200.3	53.1	230,451	33,530	0.05%	5,482	-3,700	-1,597	-3,784	-26,728
LG 전자	91,600	-0.33	36.5	51.7	45,086	-753	-0.04%	411	-202	-109	-1,975	1,716
SK 이노베이션	139,000	0.72	41.0	50.8	36,461	678	-0.41%	-1,014	771	241	815	65

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표