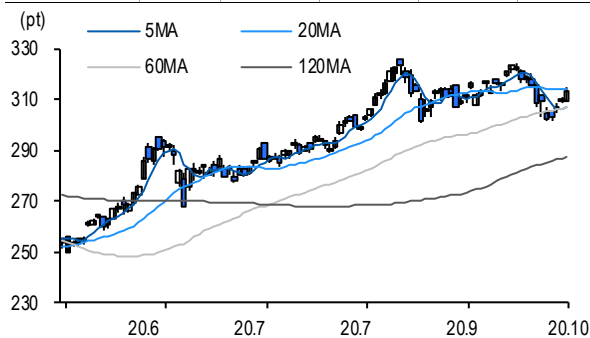


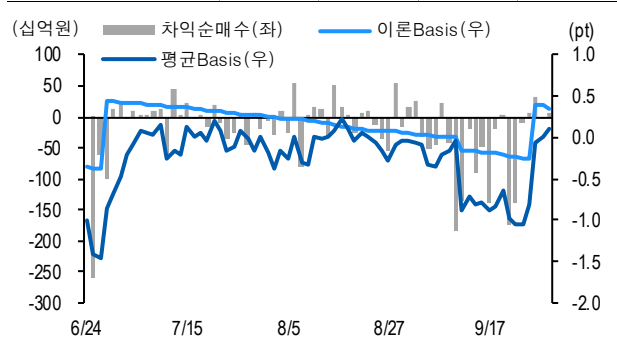
선물옵션시장 지표

2020.10.6

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.51	1.32	4.07	6,955.9	-
선물 12월물	313.90	1.27	3.95	21,918.3	273,844
선물 3월물	310.55	1.30	4.00	13.5	4,342
10월물(mini)	313.80	1.28	3.96	2,466.3	115,158
11월물(mini)	313.98	1.40	4.34	93.9	9,631



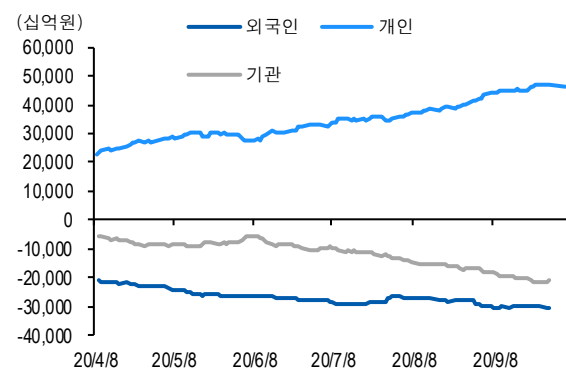
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.36	0.11	0.39	-0.08%
베이스(mini)	0.02	0.03	0.29	0.00%
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.39	-3.35	0.02%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	0.29	0.29	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	172.9	47.5	220.5	0.0	111.0	175.0	246.8	3.7	-1.4	33.2
개인	-551.7	34.4	-517.3	0.0	1.6	-112.7	-33.4	0.4	0.0	-10.6
기관	386.9	-85.2	301.8	5.8	-13.2	-61.5	-212.6	-2.5	2.9	-23.0
금융투자	249.5	-105.3	144.2	4.6	-14.0	-333.3	-212.2	-1.1	3.1	-9.6
투신	18.0	31.8	49.8	0.0	6.6	250.4	-0.4	-1.1	0.1	-17.6
은행+보험+기타금융	29.3	-10.6	18.7	0.0	1.8	27.0	0.0	-0.2	-0.3	0.4
연기금+국가자재	70.4	2.8	73.2	-0.4	-6.9	-5.5	0.0	0.0	0.0	3.8
기타법인	-8.2	3.3	-4.9	0.0	0.2	-0.8	-0.8	-1.7	-1.4	0.4

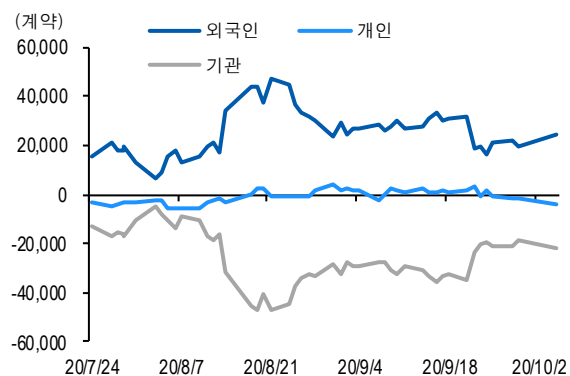
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,521,063	382.8	839,912	20.8%	지수옵션 전체	3,018,624	614.4	2,201,426
Put	1,497,561	231.6	1,361,514	24.2%	PCR(금액기준)	0.60	VKOSPI	23.87%(-0.28%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	1.15	0.27	225,948	18,958	-1,619	20.3	Put	312.5(K+1)	2.19	-2.93	51,351	9,899	3,561	20.5
	315.0(K+2)	2.11	0.61	227,598	23,273	-1,004	21.2		310.0(K+0)	1.42	-2.49	106,600	21,063	4,763	21.8
	312.5(K+1)	3.48	1.07	114,925	12,396	-470	22.5		307.5(K-1)	0.90	-2.02	111,829	14,121	6,327	23.1
	310.0(K+0)	5.22	1.61	39,675	16,321	810	24.1		305.0(K-2)	0.57	-1.58	153,935	26,710	7,606	24.5
	307.5(K-1)	7.23	2.09	5,756	5,786	-702	26.2		302.5(K-3)	0.36	-1.19	115,027	20,286	8,854	25.8

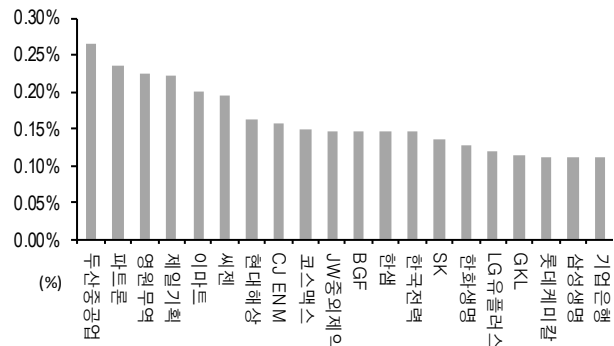
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,414,166	3,221.5	6,017,961	21,062	38,055	-26,661	-16,276	33.2	-10.6	-23.0			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	75,600	-0.79	14.9	81.4	29,876	-960	-0.06%	-282	1,263	-1,006	-1,197	175
삼성전자	58,900	0.68	901.9	78.8	1,098,567	-127,800	-0.04%	22,101	-13,684	-14,579	-1,032	18,805
LG 전자	92,000	0.44	59.7	71.8	34,460	-10,626	-0.07%	1,103	75	-1,479	-646	5,908
삼성 SDI	438,000	0.69	76.5	66.6	9,241	-6,587	-0.07%	-1,012	157	854	-2	1,927
삼성전기	140,500	1.44	40.5	66.4	31,203	-2,662	-0.22%	-5	1,311	-1,302	2,772	527
SK 하이닉스	83,300	-0.83	180.6	65.6	158,018	-72,433	-0.05%	-4,908	-11,863	17,374	29,318	20,391
LG 화학	662,000	1.38	190.3	65.5	28,921	-6,137	0.09%	2,607	-281	-2,311	-1,623	-388
카카오	370,500	1.51	116.3	61.0	34,880	-4,497	0.02%	1,978	200	-2,197	-1,071	-4,697
기아차	50,500	7.33	115.5	55.8	121,495	26,999	0.00%	30	9,151	-9,231	-6,514	-10,684
한국금융지주	74,200	2.49	17.1	52.0	20,707	-4,360	0.03%	-983	1,615	-632	227	-651

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터