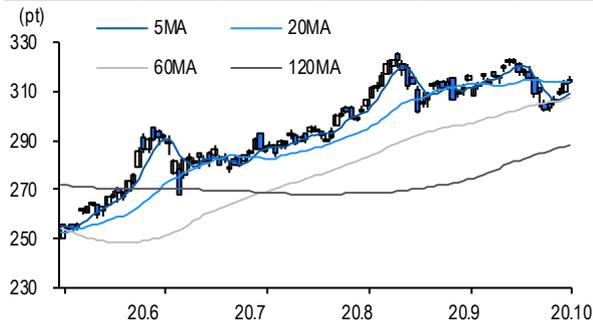


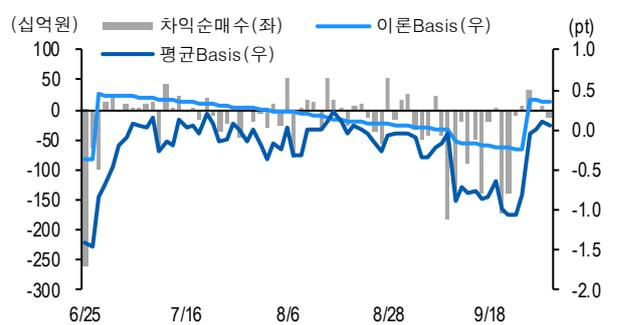


선물옵션시장 지표 2020.10.7

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.45	0.30	0.94	6,335.3	-
선물 12월물	314.40	0.16	0.50	19,160.4	272,737
선물 3월물	311.00	0.14	0.45	11.5	4,564
10월물(mini)	314.36	0.18	0.56	2,192.8	110,436
11월물(mini)	314.52	0.17	0.54	150.4	17,535

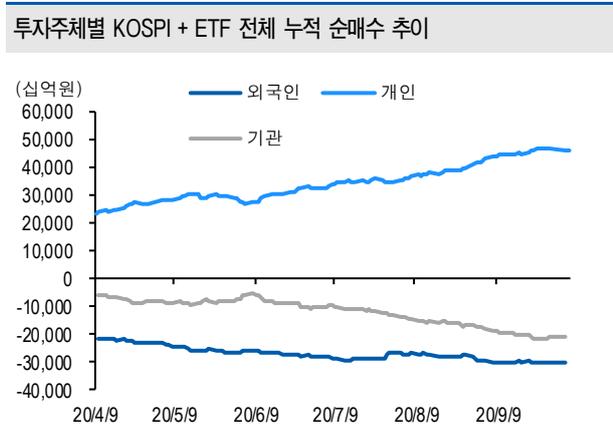


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.35	0.04	-0.05	-0.10%
베이스(mini)	0.01	0.06	-0.09	0.02%
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.39	-3.40	0.02%
합성선물 베이스(ATM)	0.01	-0.06	-0.06	-0.02%

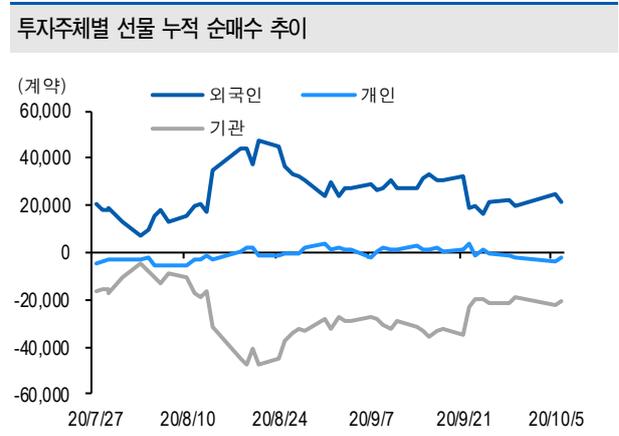


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	32.2	30.8	63.0	-4.0	-23.9	-239.9	-33.0	2.2	-2.9	11.4
개인	-5.2	1.9	-3.4	0.0	0.4	136.4	6.0	0.3	0.7	15.8
기관	-35.5	-29.7	-65.3	-8.2	-70.3	97.0	26.6	-1.5	2.5	-30.8
금융투자	-45.8	14.7	-31.1	-1.6	-15.5	284.9	26.4	-1.2	2.5	-15.3
투신	1.2	-10.4	-9.1	0.0	-20.7	-210.5	0.2	-0.4	-0.1	0.0
은행+보험+기타금융	-5.7	-39.4	-45.2	0.0	-28.0	18.6	0.0	0.0	0.0	-5.6
연기금+국가자재	23.6	0.9	24.5	-6.6	-2.7	4.0	0.0	0.0	0.0	-9.8
기타법인	8.5	-2.9	5.7	0.0	-0.4	6.5	0.4	-0.9	-0.2	3.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,219,355	259.3	874,884	18.2%	지수옵션 전체	2,547,161	495.5	2,284,617
Put	1,327,806	236.3	1,409,733	21.5%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	22.29%(-1.58%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	0.38	-0.19	276,275	34,122	111	18.0	Put	315.0(K+1)	2.45	-0.88	96,512	15,148	4,084	19.1
	317.5(K+2)	0.89	-0.26	198,141	21,263	2,305	18.0		312.5(K+0)	1.38	-0.81	152,772	14,711	4,812	19.6
	315.0(K+1)	1.83	-0.28	125,930	24,659	1,386	18.3		310.0(K-1)	0.74	-0.68	187,898	25,265	4,202	20.6
	312.5(K+0)	3.27	-0.21	34,732	11,693	-703	18.9		307.5(K-2)	0.39	-0.51	139,115	21,727	7,606	21.7
	310.0(K-1)	5.14	-0.08	7,406	15,247	-1,074	19.8		305.0(K-3)	0.22	-0.35	178,333	27,184	474	23.4

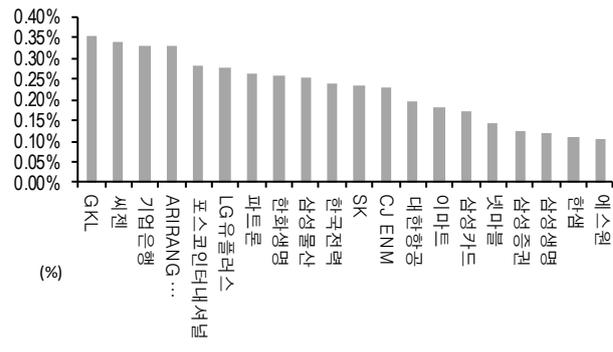
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,525,365	3,362.9	6,093,633	75,672	84	29,900	-31,569	11.4	15.8	-30.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	24,550	-0.81	8.4	148.6	21,865	-20,802	0.02%	-394	-442	837	592	212
대림산업	79,300	-1.61	16.6	120.5	15,857	-4,343	0.03%	137	354	-493	-1,332	864
삼성전자	59,200	0.51	794.5	93.5	978,711	-119,856	0.02%	9,650	-16,550	7,579	2,217	-18,172
호텔신라	74,200	-1.85	30.9	91.2	19,768	-10,108	-0.11%	-123	921	-1,243	2,873	5,921
LG 전자	94,500	2.72	207.5	79.3	24,859	-9,601	-0.07%	1,527	2,664	-3,995	3,000	1,904
삼성 SDI	435,000	-0.68	55.7	74.6	8,415	-826	-0.01%	14	49	-62	85	-2
SK 하이닉스	83,100	-0.24	155.9	68.7	94,024	-63,994	-0.12%	2,447	609	-3,343	21,721	8,842
LG 디스플레이	15,300	-1.92	21.8	67.6	217,229	-66,982	-0.84%	25,840	1,278	-27,698	-21,563	13,708
한화솔루션	42,300	0.36	111.8	61.9	45,187	-22,949	-0.06%	-11,229	5,807	5,777	3,995	14,028
NAVER	305,500	2.17	157.9	61.0	33,479	4,962	0.07%	2,227	2,742	-5,488	-7,321	-1,811

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터