

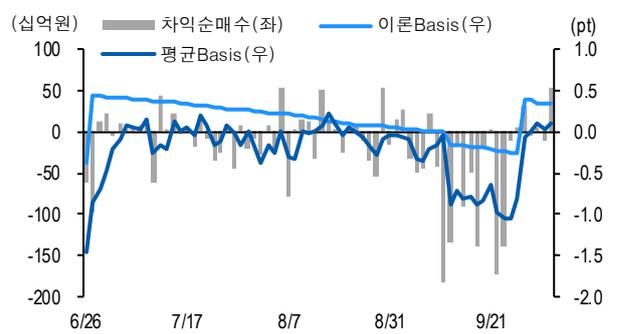


선물옵션시장 지표 2020.10.8

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.35	0.92	2.90	5,187.4	-
선물 12월물	317.70	1.05	3.30	23,349.0	277,509
선물 3월물	313.95	0.95	2.95	12.8	4,594
10월물(mini)	317.72	1.07	3.36	2,518.6	110,463
11월물(mini)	317.60	0.98	3.08	219.0	23,931

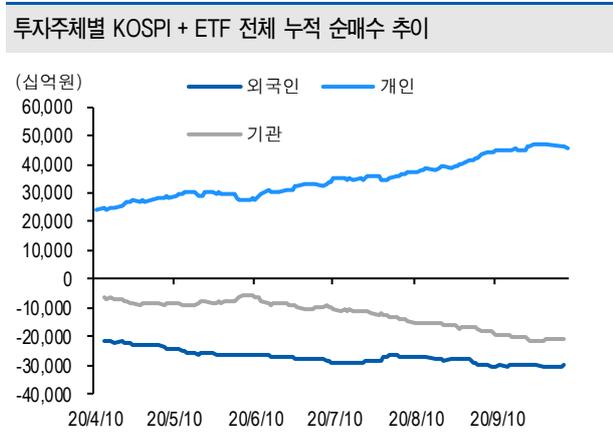


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.35	0.10	0.35	-0.08%	
베이스(mini)	0.01	0.07	0.37	0.02%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.47	-3.50	-0.01%	
합성선물 베이스(ATM)	0.01	0.24	0.24	0.07%	

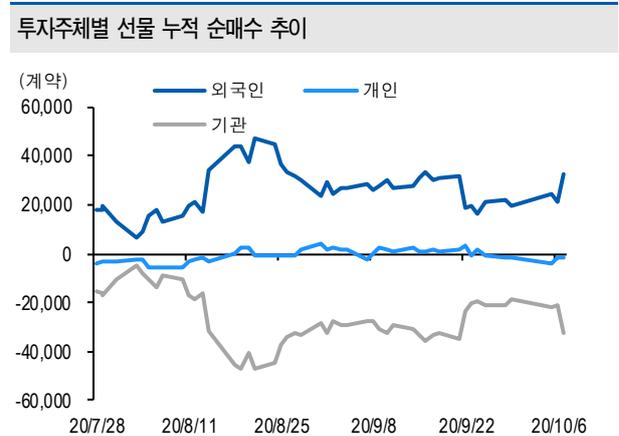


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-95.1	11.3	-83.8	0.0	-88.1	563.5	328.6	3.9	-0.9	11.7
개인	-345.4	91.4	-253.9	0.0	2.1	68.1	-21.3	-3.3	0.5	12.7
기관	429.7	-106.7	323.0	54.5	-22.1	-603.1	-306.9	-0.6	0.9	-27.1
금융투자	395.3	-96.6	298.7	6.3	-7.3	-756.7	-306.9	1.2	0.9	-41.8
투신	-21.9	2.6	-19.2	0.0	-11.4	204.4	0.0	-1.8	0.1	1.3
은행+보험+기타금융	10.3	-0.6	9.7	0.0	4.1	2.7	0.0	0.0	0.0	-1.3
연기금+국가지자체	44.3	-13.4	30.9	48.3	-2.7	-53.5	0.0	0.0	0.0	14.7
기타법인	10.8	3.9	14.7	0.0	0.1	-28.4	-0.3	-0.1	-0.6	2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,712,911	363.5	899,091	18.3%	지수옵션 전체	3,396,281	637.5	2,406,559
Put	1,683,370	273.9	1,507,468	19.9%	PCR(금액기준)	0.75	VKOSPI	21.55%(-0.74%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	0.20	0.05	288,769	40,748	4,560	17.2	Put	317.5(K+1)	1.48	-2.51	52,365	8,263	4,671	15.0
	320.0(K+2)	0.63	0.25	383,442	33,430	-692	17.2		315.0(K+0)	0.63	-1.82	161,621	24,770	9,622	16.4
	317.5(K+1)	1.61	0.72	352,644	21,006	-257	17.9		312.5(K-1)	0.27	-1.11	258,833	25,510	10,799	18.3
	315.0(K+0)	3.22	1.39	287,628	23,297	-1,362	19.3		310.0(K-2)	0.12	-0.62	309,787	37,144	11,879	20.3
	312.5(K-1)	5.40	2.13	93,440	12,098	405	23.1		307.5(K-3)	0.05	-0.34	200,279	24,613	2,886	21.9

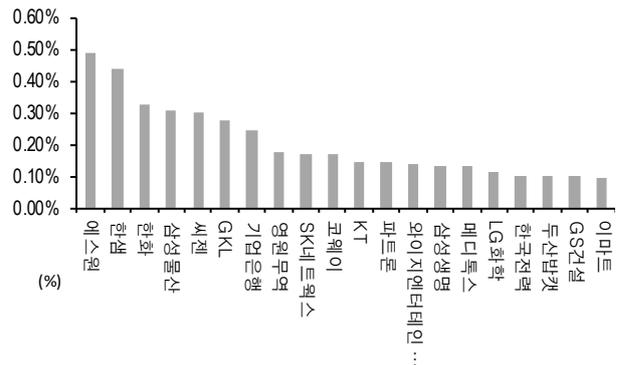
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,379,645	3,119.3	6,197,992	104,359	32,437	25,016	-60,781	11.7	12.7	-27.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,100	1.52	824.5	94.2	712,642	-266,069	-0.01%	7,636	4,924	-13,015	-26,364	5,453
호텔신라	75,000	1.08	11.9	84.6	19,531	-237	-0.04%	107	-261	-1,058	243	-1,187
LG 전자	96,200	1.80	95.2	80.1	16,862	-7,997	-0.09%	2,964	-2,129	-842	-1,454	791
LG 화학	681,000	0.74	152.4	78.5	17,473	-6,814	0.11%	-696	239	450	-407	480
이마트	146,500	1.74	20.2	71.6	12,703	-5,276	0.09%	1,126	-179	-950	-2,681	1,155
삼성 SDI	439,000	0.92	64.1	71.3	5,798	-2,617	-0.01%	510	73	-484	-478	78
카카오	380,500	-0.52	105.3	70.0	23,886	-10,387	0.07%	-893	-15	990	593	790
현대차	183,000	0.27	178.6	65.4	61,822	-18,282	-0.02%	1,215	4,974	-6,293	-4,446	1,069
GS 건설	25,350	3.26	6.5	63.9	17,378	-4,487	0.10%	-1,439	4,262	-2,823	-32	-2,994
LG 이노텍	166,500	6.39	25.1	61.4	7,877	-2,256	-0.04%	1,398	1,373	-2,765	-2,042	-1,336

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터