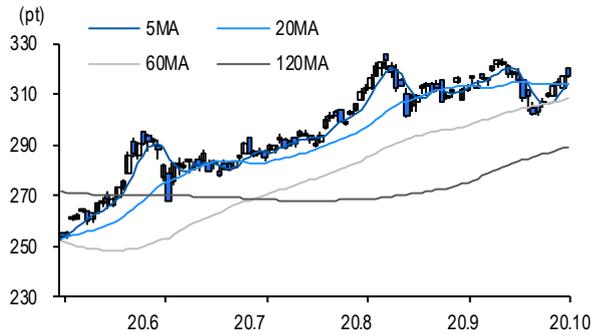


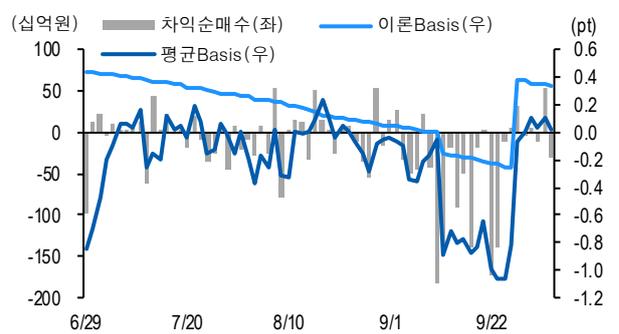


선물옵션시장 지표 2020.10.12

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.47	0.04	0.12	8,471.9	-
선물 12월물	318.00	0.09	0.30	25,107.8	271,975
선물 3월물	314.50	0.18	0.55	63.4	5,189
10월물(mini)	318.18	0.14	0.46	1,706.7	0
11월물(mini)	318.20	0.19	0.60	1,319.6	34,112

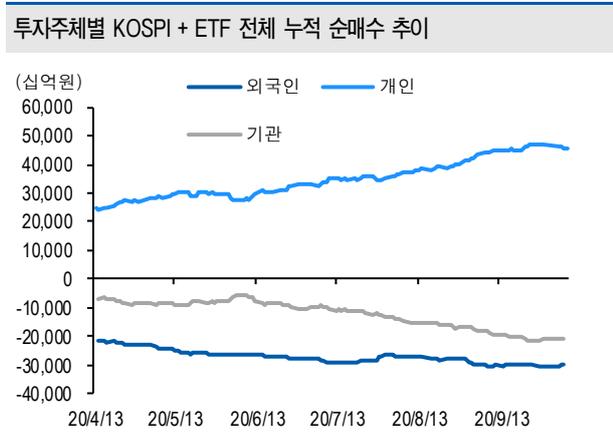


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.35	0.02	0.53	-0.10%
베이스(mini)	0.00	0.06	0.71	0.02%
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.67	-3.70	-0.07%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	0.67	0.67	0.21%

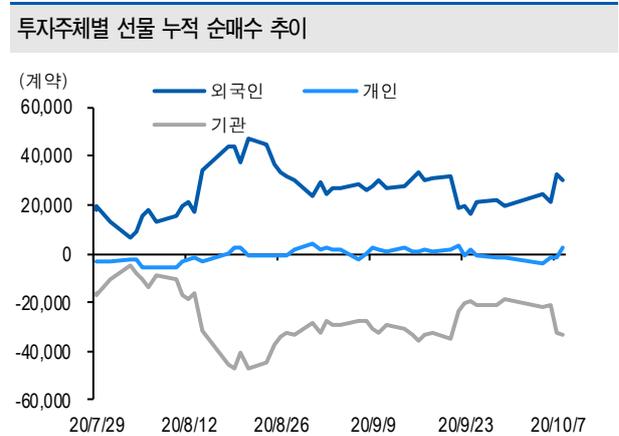


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	760.4	-2.7	757.7	-2.5	543.1	-100.0	-100.3	0.1	1.4	-14.8
개인	-165.9	-8.0	-173.9	0.0	-1.2	265.5	29.5	3.0	-0.4	21.9
기관	-615.0	10.3	-604.7	-27.2	-338.7	-181.3	71.6	-3.7	-0.8	-6.1
금융투자	-557.0	167.3	-389.7	0.0	-309.0	94.2	72.2	1.2	-0.2	1.2
투신	26.3	-97.3	-71.0	0.0	1.9	-231.3	-0.4	-3.1	-0.1	57.0
은행+보험+기타금융	-1.6	-39.5	-41.1	-0.5	-13.6	-66.2	-0.2	-1.3	-0.6	-3.2
연기금+국가자재	-99.4	-23.6	-122.9	-26.7	-16.5	22.0	0.0	-0.6	0.2	-61.2
기타법인	20.6	0.4	21.0	0.0	0.1	15.7	-0.8	0.7	-0.3	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,993,211	364.6	447,835	12.8%	지수옵션 전체	4,094,536	682.2	1,171,213
Put	2,101,325	317.6	723,378	8.5%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	21.00%(-0.55%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.01	-0.05	117,869	0	-36,873	19.0	Put	320.0(K+1)	1.98	-1.04	222,252	0	-3,837	14.9
	322.5(K+2)	0.01	-0.19	381,266	0	-40,748	13.4		317.5(K+0)	0.17	-1.31	659,310	0	-8,263	2.4
	320.0(K+1)	0.03	-0.60	781,591	0	-33,430	9.1		315.0(K-1)	0.01	-0.62	639,740	0	-24,770	7.4
	317.5(K+0)	0.81	-0.80	434,529	0	-21,006	12.4		312.5(K-2)	0.01	-0.26	225,152	0	-25,510	13.5
	315.0(K-1)	3.13	-0.09	98,314	0	-23,297	24.2		310.0(K-3)	0.01	-0.11	84,807	0	-37,144	19.4

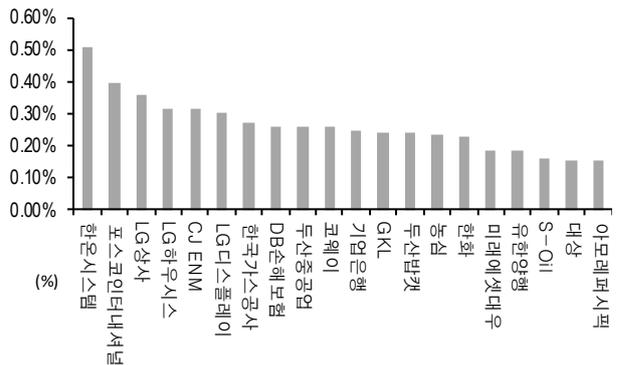
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,776,366	4,570.1	4,709,958	-1,488,034	-26,514	16,231	13,525	-14.8	21.9	-6.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,000	-0.17	751.4	51.0	0	-712,642	-0.06%	-5,370	27	8,232	10,604	-19,030
삼성전기	140,500	-1.75	40.1	49.2	0	-22,500	-0.16%	-834	972	-159	1,326	-376
미래에셋대우	8,820	4.38	15.1	48.4	0	-144,346	0.18%	3,394	513	-3,905	3,453	-32,878
포스코케미칼	87,300	3.68	16.3	44.5	0	-18,337	0.15%	177	56	-232	74	-4,884
이마트	149,500	2.05	19.6	43.1	0	-12,703	-0.03%	44	71	-106	-3,690	1,092
KT	22,950	-0.43	9.2	39.1	0	-62,392	0.03%	3,752	-2,874	-848	537	-1,472
한세실업	18,950	-1.04	3.0	31.9	0	-15,178	-0.04%	-491	168	323	-2,691	3,005
현대차	180,500	-1.37	96.6	30.4	0	-61,822	-0.20%	-1,326	142	1,223	2,737	2,617
NAVER	301,000	-1.15	69.3	30.3	0	-29,706	-0.08%	1,033	-526	-429	5,067	-3,911
와이엔티 인먼트	49,800	-3.49	13.2	29.5	0	-22,375	-0.07%	-726	129	597	8,961	-80

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

