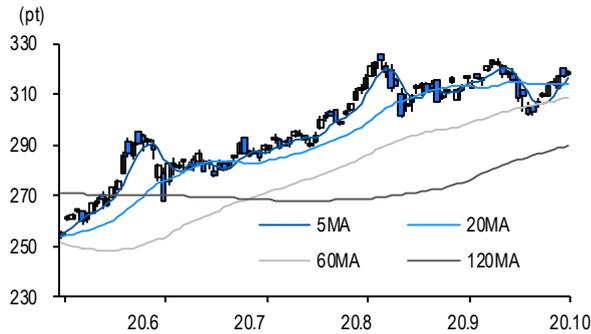


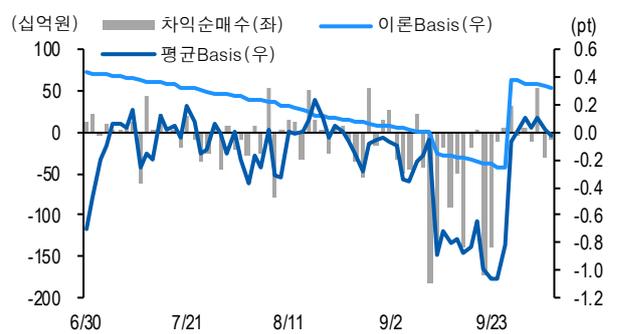


선물옵션시장 지표 2020.10.13

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	319.15	0.53	1.68	6,807.5	-	
선물 12월물	319.30	0.41	1.30	16,750.0	273,141	
선물 3월물	315.20	0.22	0.70	75.7	6,517	
11월물(mini)	319.28	0.34	1.08	1,992.4	41,141	
12월물(mini)	319.20	0.38	1.20	42.4	6,786	

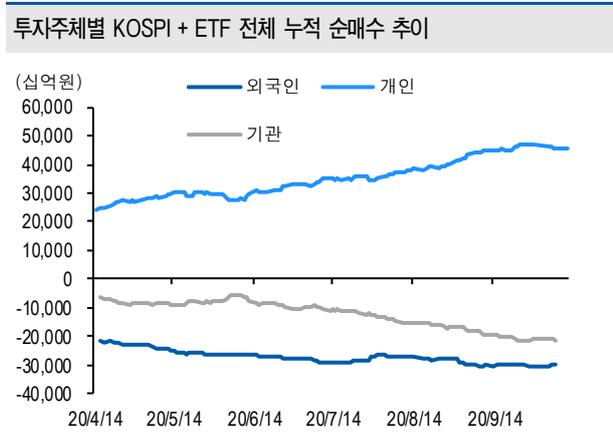


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.33	-0.03	0.15	-0.11%	
베이스(mini)	0.17	0.02	0.13	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-3.44	-4.05	-4.15	-0.19%	
합성선물 베이스(ATM)	0.17	0.21	0.21	0.01%	

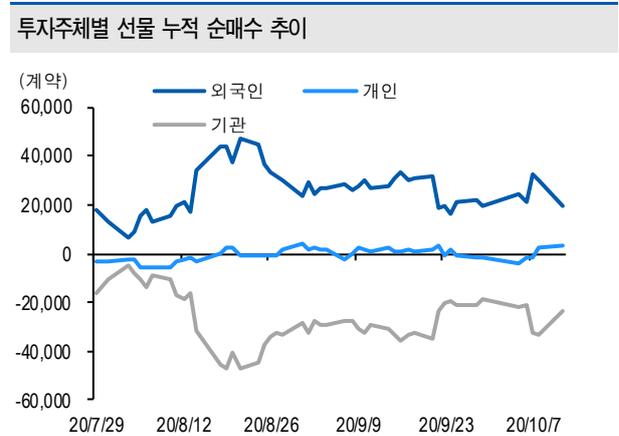


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	138.1	8.1	146.2	0.0	-31.3	-122.6	1.6	-0.4	-1.2	12.2	
개인	-234.3	-33.4	-267.8	0.0	0.1	34.1	7.2	0.7	-0.7	107.5	
기관	84.0	26.0	110.0	-8.6	-59.8	86.5	-8.6	-0.2	2.1	-121.7	
금융투자	78.6	77.9	156.6	0.0	-11.0	93.3	-8.7	2.6	3.0	-51.5	
투신	6.1	3.5	9.6	0.0	-15.6	-46.1	0.0	-2.6	-1.8	-8.0	
은행+보험+기타금융	-5.4	-47.2	-52.6	0.0	-9.5	36.2	0.0	-0.2	0.9	2.9	
연기금+국가자재	22.5	-9.7	12.8	-8.6	-21.9	3.2	0.0	0.0	0.0	-65.0	
기타법인	12.2	-0.6	11.6	0.0	0.1	2.0	-0.2	-0.2	-0.2	2.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	416,252	182.6	489,686	17.8%	지수옵션 전체	950,377	351.0	1,320,081
Put	534,125	168.4	830,395	19.7%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	20.36%(-0.64%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	4.29	-0.07	12,799	4,661	898	17.7	Put	320.0(K+1)	7.25	-1.21	2,826	2,935	234	18.3
	322.5(K+2)	5.36	-0.02	7,995	1,941	449	18.0		317.5(K+0)	6.14	-1.19	6,907	3,008	1,592	18.7
	320.0(K+1)	6.62	0.08	8,037	3,120	-12	18.4		315.0(K-1)	5.19	-1.10	8,430	3,082	711	19.1
	317.5(K+0)	8.00	0.16	6,880	4,553	3,299	18.8		312.5(K-2)	4.39	-1.03	5,448	1,612	361	19.6
	315.0(K-1)	9.45	0.11	1,455	2,238	-261	18.9		310.0(K-3)	3.70	-0.95	14,933	4,259	320	20.1

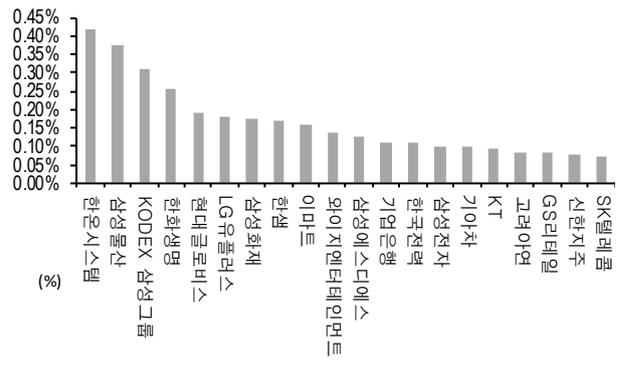
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,523,140	2,460.6	5,082,636	372,678	2,901	154,765	-164,953	12.2	107.5	-121.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,600	1.17	678.4	70.1	1,305,928	85,288	0.10%	21,864	52,377	-75,961	-65,853	-33,917
LG 화학	675,000	-2.88	220.1	59.5	30,570	-207	0.06%	-171	1,451	-1,357	-780	822
대림산업	78,800	0.64	8.7	58.9	18,287	932	0.02%	499	-340	-173	-578	-737
기아차	49,800	-1.78	62.0	50.2	118,045	4,832	0.10%	1,916	528	-2,438	-138	-3,971
한화솔루션	49,100	0.41	144.4	50.0	96,524	3,912	0.01%	-5,781	8,179	-2,365	616	-2,497
NAVER	292,000	-3.31	123.6	49.3	32,353	-2,194	-0.01%	-946	-79	1,107	-1,924	4,434
삼성전기	141,500	0.00	22.6	48.1	26,289	583	-0.10%	-491	1,729	-1,235	310	271
현대차	180,000	-0.83	142.1	48.1	81,444	2,418	-0.08%	1,975	4,203	-6,158	897	-5,270
SK 하이닉스	85,600	2.51	178.0	47.5	185,331	55,760	0.05%	1,846	27,904	-30,853	-18,530	-31,426
카카오	371,500	-2.24	83.0	47.1	29,688	-1,749	-0.28%	316	28	-285	1,975	1,236

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터