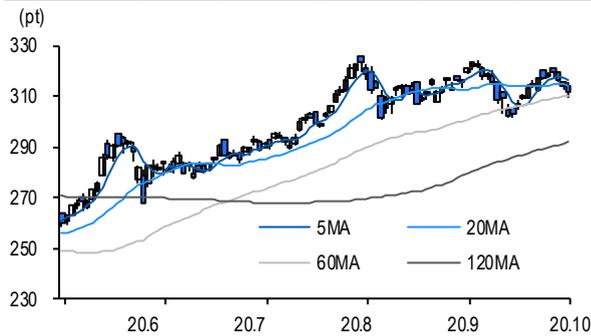


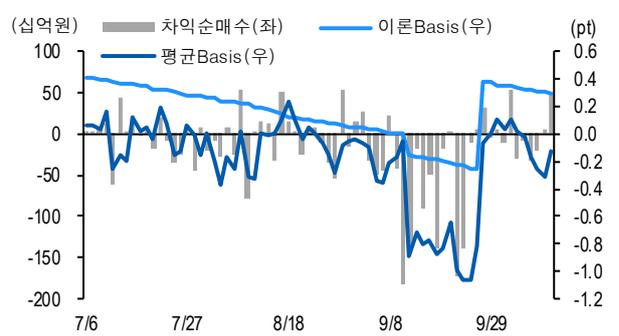


선물옵션시장 지표 2020.10.19

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.83	-0.67	-2.09	6,153.1	-
선물 12월물	312.15	-0.37	-1.15	20,828.2	281,231
선물 3월물	307.20	-0.58	-1.80	48.5	10,878
11월물(mini)	312.24	-0.41	-1.28	2,218.2	59,599
12월물(mini)	312.00	-0.41	-1.52	48.6	13,663



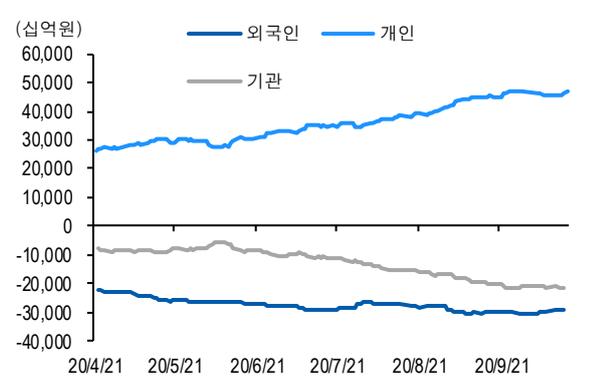
차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.30	-0.12	0.32	-0.13%	
베이스(mini)	0.15	0.03	0.41	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.57	-4.55	-0.36%	
합성선물 베이스(ATM)	0.15	0.37	0.37	0.07%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-173.1	18.2	-155.0	0.0	-133.1	316.3	65.9	-1.2	1.7	34.8	
개인	489.7	4.4	494.1	0.0	-0.2	-5.8	-7.0	0.0	1.4	-16.3	
기관	-201.9	-21.0	-222.9	50.8	-152.8	-313.5	-59.4	2.0	-3.1	-18.8	
금융투자	87.5	-22.6	64.9	0.0	-1.3	78.6	-59.3	2.6	-3.2	28.4	
투신	-56.6	-1.8	-58.4	0.0	-30.2	-138.9	-0.1	-0.5	0.1	-54.9	
은행+보험+기타금융	-21.1	40.6	19.5	0.0	-3.7	-60.9	0.0	0.0	0.1	-0.5	
연기금+국가자재	-161.0	-8.6	-169.6	50.8	-113.7	-192.3	0.0	0.0	0.0	8.3	
기타법인	-114.7	-1.5	-116.2	0.0	-1.7	3.0	0.5	-0.9	0.0	0.3	

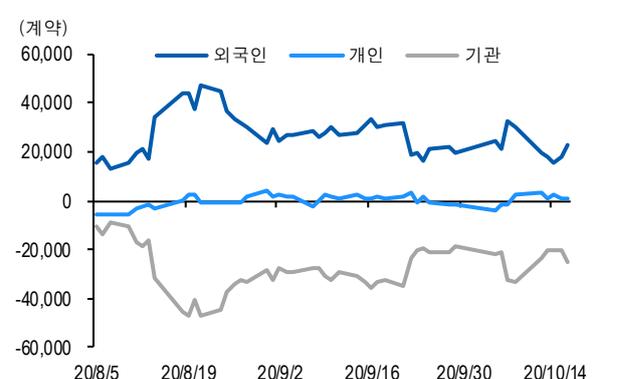
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	640,484	224.1	595,860	18.3%	지수옵션 전체	1,418,118	512.8	1,628,640
Put	777,634	288.7	1,032,780	20.1%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	22.03%(+0.56%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	2.45	-0.43	42,587	6,436	2,430	18.2	Put	317.5(K+1)	9.52	0.75	1,018	3,818	-191	18.4
	320.0(K+2)	3.23	-0.54	36,090	6,317	998	18.5		315.0(K+0)	8.11	0.62	3,982	5,346	210	18.7
	317.5(K+1)	4.16	-0.64	17,260	6,334	311	18.9		312.5(K-1)	6.88	0.53	6,305	3,914	544	19.2
	315.0(K+0)	5.31	-0.70	12,381	4,127	1,399	19.4		310.0(K-2)	5.85	0.49	11,292	6,770	1,003	19.8
	312.5(K-1)	6.62	-0.83	5,672	2,112	706	19.9		307.5(K-3)	4.94	0.40	13,013	5,226	-385	20.3

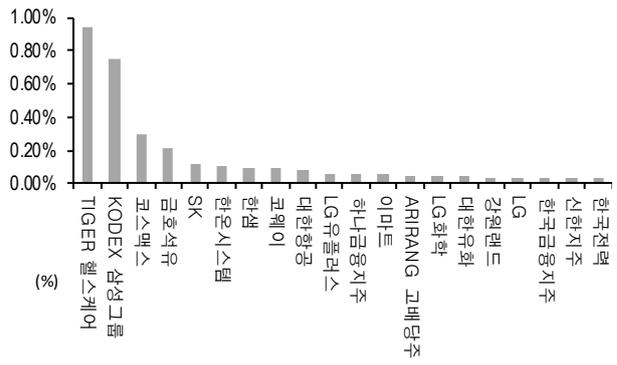
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,361,633	3,149.7	5,336,114	-39,456	69,088	-37,178	-37,096	34.8	-16.3	-18.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	59,800	-0.50	1,132.1	118.3	1,407,217	-7,759	0.01%	22,381	-24,426	2,170	-1,028	11,719
SK 하이닉스	85,600	-1.95	211.5	101.3	233,372	-9,200	0.01%	1,525	3,383	-5,056	760	8,327
LG 화학	642,000	0.63	188.0	95.5	26,230	2	0.04%	-117	-77	190	615	-445
삼성전기	138,000	-0.72	29.0	69.8	24,411	-1,955	-0.14%	1,321	515	-1,836	-522	-240
기아차	47,200	-3.08	78.6	66.0	43,679	-38,546	-0.13%	3,104	-2,852	-242	13,249	17,141
NAVER	294,500	0.86	80.8	61.5	30,959	2,327	-0.01%	103	-774	671	-220	-1,551
한화솔루션	44,450	-4.10	130.4	58.4	71,430	-14,874	-0.03%	-728	-7,422	8,109	7,364	15,746
삼성 SDI	421,000	-1.98	72.2	57.2	12,626	246	-0.03%	1,001	687	-1,641	-322	-1,128
LG 전자	89,600	-1.54	37.8	56.2	20,643	-505	-0.36%	-444	-3,837	4,381	2,684	1,773
LG 생활건강	1,571,000	0.71	20.9	51.0	1,253	81	-0.08%	-10	-65	75	-1	-20

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터