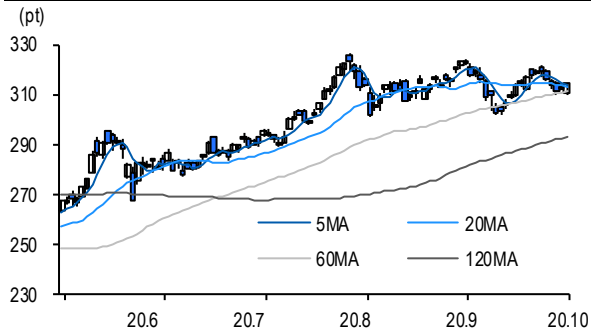


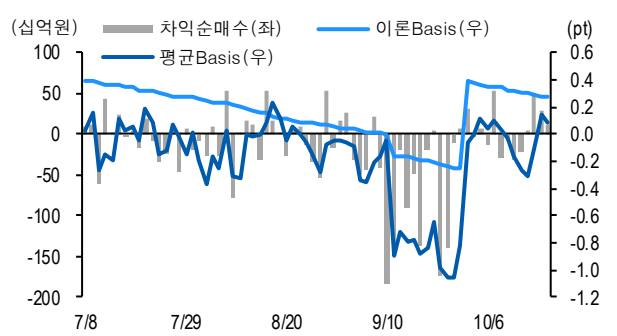


선물옵션시장 지표 2020.10.21

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	314.71	0.68	2.12	8,067.9	-	
선물 12월물	315.00	0.82	2.55	23,725.2	281,939	
선물 3월물	310.20	0.86	2.65	18.3	12,542	
11월물(mini)	315.00	0.81	2.54	2,697.4	78,680	
12월물(mini)	315.10	0.84	2.62	37.8	14,579	

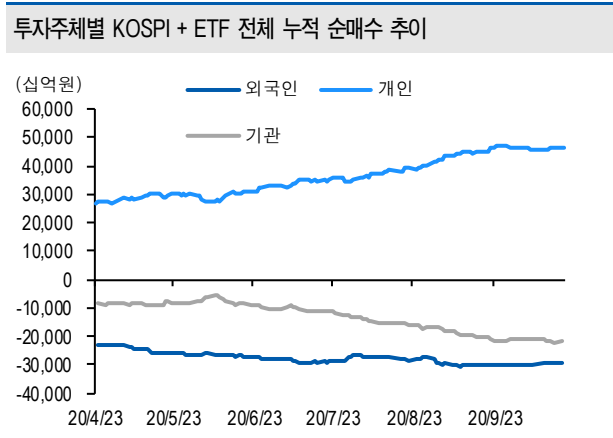


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.28	0.08	0.29	-0.06%	
베이스스(mini)	0.12	0.03	0.29	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.50	-4.45	-0.34%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	0.26	0.26	0.04%	

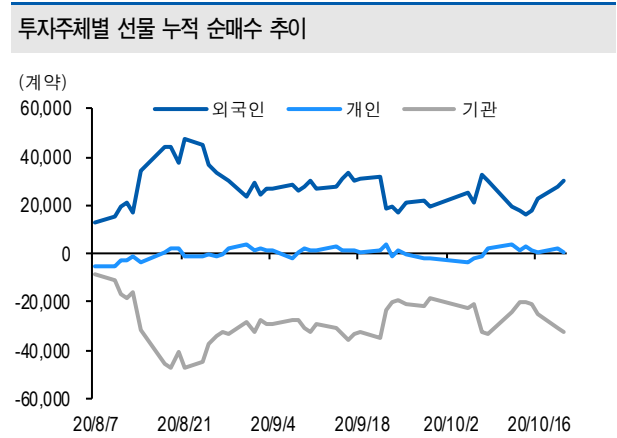


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	43.7	18.3	62.0	0.7	51.4	147.6	72.6	-3.0	2.7	62.7	
개인	-292.1	1.2	-291.0	0.0	-0.3	-87.3	-20.2	1.4	-0.1	-15.5	
기관	260.1	-20.4	239.8	11.4	-16.8	-77.1	-52.7	1.7	-2.3	-51.1	
금융투자	222.3	-39.0	183.3	0.0	0.2	-168.6	-53.4	2.0	0.1	-67.3	
투신	11.2	19.1	30.4	0.0	-0.6	118.2	0.8	-0.3	0.2	94.8	
은행+보험+기타금융	-9.4	9.0	-0.5	0.0	-2.1	-24.7	0.0	0.0	-2.7	0.0	
연기금+국가지자체	73.3	-14.6	58.7	11.4	-14.6	-2.1	0.0	0.0	0.0	-78.6	
기타법인	-11.7	0.9	-10.8	0.0	-0.3	16.8	0.4	-0.1	-0.2	3.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	841,516	308.3	631,297	18.9%	지수옵션 전체	1,565,705	595.5	1,731,338
Put	724,189	287.2	1,100,041	21.2%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	22.18%(-0.33%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	3.89	0.74	66,835	9,517	3,089	18.9	Put	315.0(K+1)	6.29	-1.49	4,383	5,469	216	19.3
	317.5(K+2)	4.98	0.89	31,423	6,650	115	19.2		312.5(K+0)	5.25	-1.33	8,876	4,582	222	19.8
	315.0(K+1)	6.28	1.09	15,522	5,202	638	19.8		310.0(K-1)	4.38	-1.17	14,802	6,474	-122	20.4
	312.5(K+0)	7.72	1.22	8,006	2,814	628	20.2		307.5(K-2)	3.64	-1.02	15,660	5,604	222	21.0
	310.0(K-1)	9.34	1.38	2,699	4,599	253	20.8		305.0(K-3)	3.02	-0.88	23,161	10,385	808	21.6

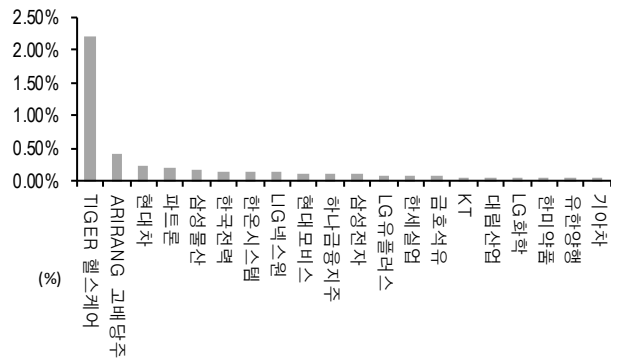
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,453,199	4,352.3	5,526,614	91,793	19,966	-40,358	15,427	62.7	-15.5	-51.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,100	1.50	1,116.3	97.2	1,447,034	41,529	0.10%	22,191	-28,408	7,331	-33,267	-6,036
LG 전자	90,800	2.14	41.1	92.7	20,677	-774	-0.25%	2,455	565	-2,955	-1,232	-2,038
기아차	47,150	1.29	183.5	92.2	84,235	45,003	0.05%	1,177	987	-2,184	-20,554	-26,563
하나금융지주	30,450	1.50	39.7	89.9	201,991	38,944	0.10%	-8,852	-2,580	11,432	-4,315	-12,496
삼성 SDI	432,500	4.72	116.5	87.4	13,133	453	-0.03%	618	-38	-833	-98	-808
SK 하이닉스	85,500	-1.72	413.2	72.9	201,109	-35,206	0.00%	-1,195	1,040	-401	12,093	9,438
NAVER	291,000	1.39	110.9	72.5	29,065	-1,920	-0.03%	1,558	324	-1,909	-579	192
현대차	168,500	0.90	667.4	72.4	82,418	22,693	0.23%	6,523	6,772	-14,155	-11,535	-20,314
한화솔루션	43,200	-0.12	144.8	72.0	27,646	-39,960	-0.10%	-555	-39,043	39,601	14,285	23,491
KB 금융	40,800	0.12	42.6	68.6	103,908	-1,501	0.03%	-5,764	151	5,659	265	341

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터