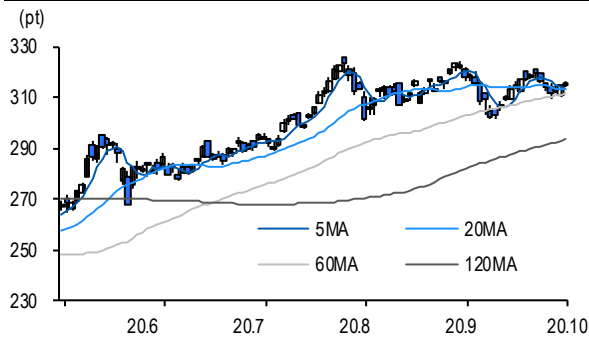


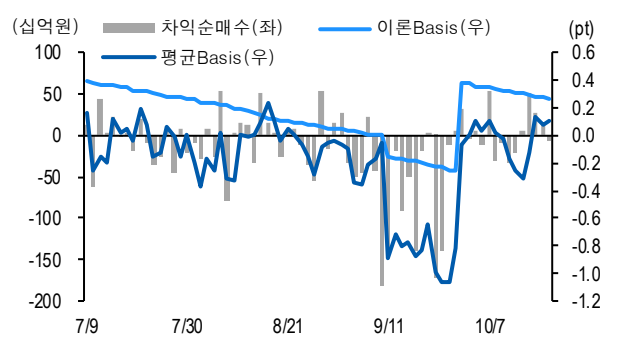


선물옵션시장 지표 2020.10.22

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.76	0.33	1.05	6,042.9	-
선물 12월물	316.10	0.35	1.10	17,719.2	281,448
선물 3월물	311.30	0.35	1.10	19.4	13,283
11월물(mini)	315.98	0.31	0.98	2,143.7	81,008
12월물(mini)	316.00	0.32	0.90	92.8	18,697

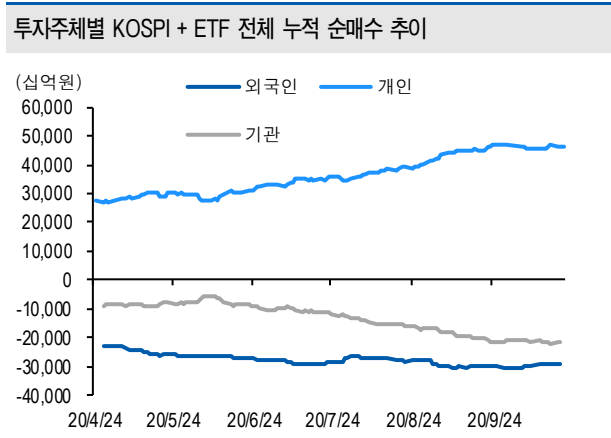


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.27	0.10	0.34	-0.05%	
베이스(mini)	0.12	0.05	0.22	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-3.44	-4.38	-4.30	-0.30%	
합성선물 베이스(ATM)	0.12	0.33	0.33	0.07%	

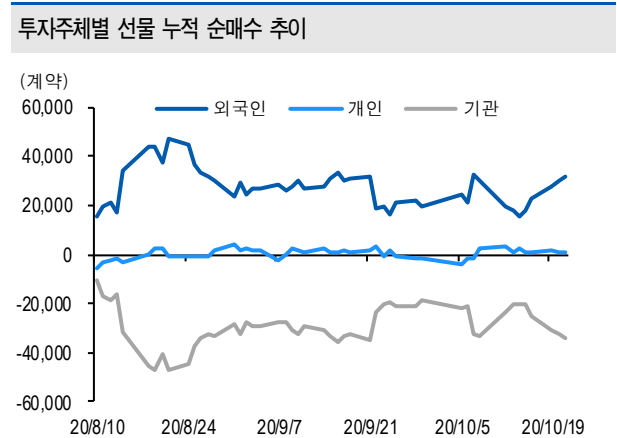


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	6.7	2.8	9.4	0.0	-29.9	88.7	-2.9	2.6	-0.1	-4.7	
개인	-130.6	-46.0	-176.6	0.0	0.3	9.7	28.9	-0.9	-1.4	37.3	
기관	113.6	47.3	160.8	-5.2	-152.5	-105.0	-25.6	-1.5	1.8	-39.6	
금융투자	186.0	74.5	260.5	0.0	-11.4	-261.1	-25.7	-1.3	1.8	-47.9	
투신	15.3	7.7	23.0	0.0	-22.7	159.2	0.2	-0.2	0.0	23.0	
은행+보험+기타금융	50.4	-28.2	22.3	0.0	20.0	-3.5	0.0	-0.1	0.0	0.1	
연기금+국가자재	-106.5	2.9	-103.6	-5.2	-129.7	0.3	-0.1	0.0	0.0	-14.9	
기타법인	10.4	-4.1	6.3	0.0	0.2	6.7	-0.3	-0.2	-0.3	7.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	522,523	249.3	638,772	18.4%	지수옵션 전체	1,094,261	457.5	1,761,896
Put	571,738	208.2	1,123,124	20.8%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	21.88%(-0.30%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	3.15	0.21	46,608	9,413	610	18.4	Put	317.5(K+1)	6.78	-0.74	1,015	4,165	106	18.7
	320.0(K+2)	4.15	0.26	29,153	9,333	-184	18.8		315.0(K+0)	5.63	-0.66	7,767	5,987	518	19.2
	317.5(K+1)	5.33	0.35	10,740	6,803	153	19.3		312.5(K-1)	4.68	-0.57	8,497	4,822	240	19.8
	315.0(K+0)	6.72	0.44	6,927	5,393	191	19.9		310.0(K-2)	3.87	-0.51	13,140	7,456	982	20.4
	312.5(K-1)	8.25	0.53	2,991	2,902	88	20.4		307.5(K-3)	3.19	-0.45	22,192	5,506	-98	21.0

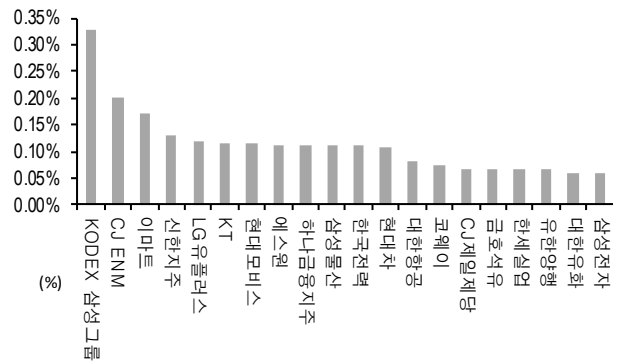
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,561,866	3,295.7	5,729,548	202,934	35,107	83,257	-127,851	-4.7	37.3	-39.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,000	-0.16	1,137.4	120.5	1,462,288	15,254	0.06%	-14,871	18,137	-11,467	-30,318	11,703
현대차	166,500	-1.19	301.2	104.4	78,103	-4,315	0.11%	-3,668	757	2,936	2,502	2,186
카카오	354,500	0.28	179.5	98.9	28,493	661	-0.20%	-1,021	-115	1,127	409	-726
삼성 SDI	435,000	0.58	90.2	87.5	11,752	-1,381	-0.06%	-1,113	-490	1,633	161	1,887
대림산업	80,200	-1.60	14.2	72.4	25,364	1,552	0.05%	1,299	454	-1,815	-1,411	-486
LG 전자	90,100	-0.77	32.3	71.7	20,805	128	-0.28%	-2,558	-112	2,805	554	2,350
LG 화학	617,000	-1.12	104.5	70.9	23,531	-56	0.04%	-311	-78	439	-46	463
기아차	45,400	-3.71	68.9	65.6	83,024	-1,211	0.03%	364	3,870	-4,179	-3,093	2,695
삼성전기	141,000	-1.05	23.6	63.5	21,558	-889	-0.06%	-2,162	376	1,686	1,118	565
현대모비스	232,500	-2.52	68.2	61.8	33,595	2,070	0.11%	-1,999	625	1,367	1,007	-1,126

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터