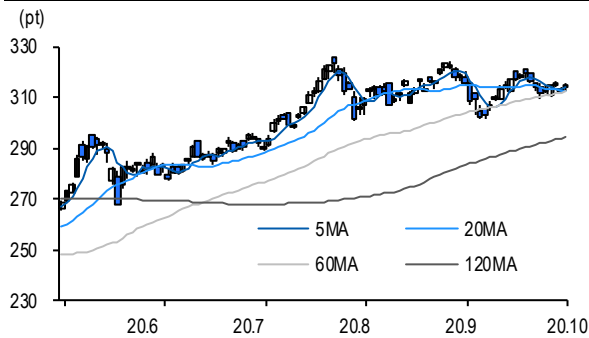


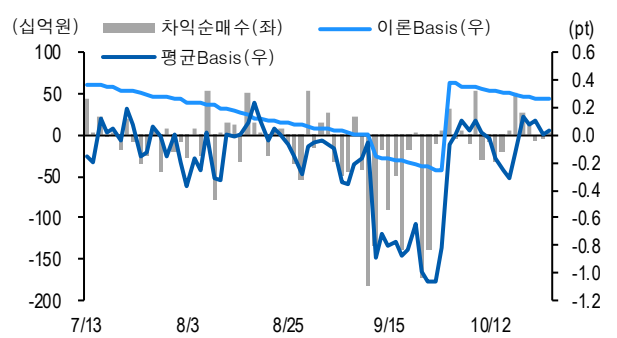


선물옵션시장 지표 2020.10.26

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.79	0.33	1.02	6,317.0	-
선물 12월물	315.30	0.51	1.60	18,691.0	283,828
선물 3월물	310.45	0.36	1.10	17.0	14,356
11월물(mini)	315.16	0.46	1.44	2,190.0	82,552
12월물(mini)	314.98	0.41	1.38	30.4	30,253

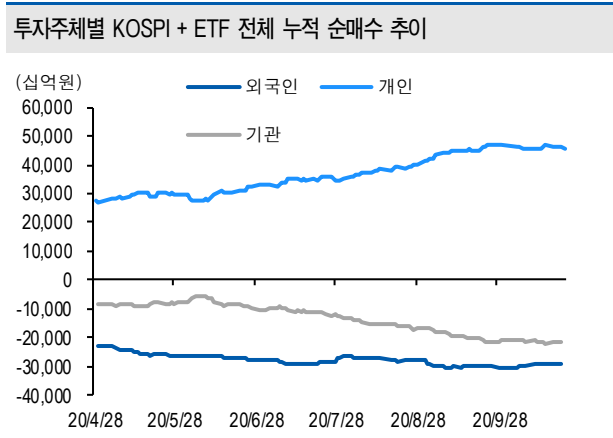


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.26	0.04	0.51	-0.07%	
베이스(mini)	0.11	0.02	0.37	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.45	-4.45	-0.32%	
합성선물 베이스(ATM)	0.11	0.43	0.43	0.10%	

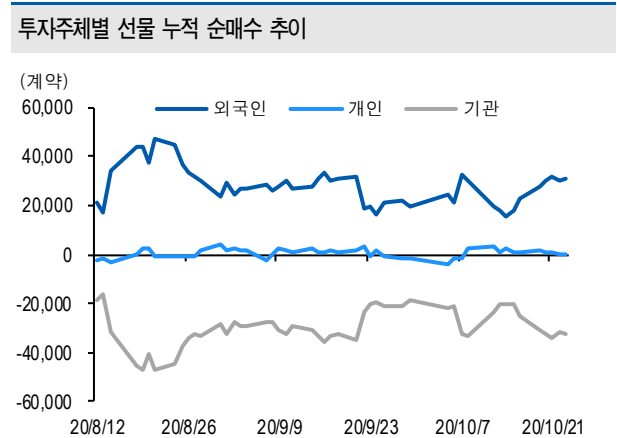


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	38.8	17.7	56.5	0.0	-25.3	117.6	-26.5	-0.1	-0.2	-4.5	
개인	-272.3	5.8	-266.5	0.0	1.7	-5.7	-2.2	-0.6	-0.6	19.2	
기관	233.4	-21.4	212.0	3.9	-9.9	-104.2	28.8	0.8	0.9	-11.9	
금융투자	63.6	-96.7	-33.1	0.0	2.7	-344.9	30.1	1.1	0.9	-16.1	
투신	39.9	91.8	131.7	0.0	-1.8	265.2	-1.3	-0.3	0.0	-12.2	
은행+보험+기타금융	18.0	-4.2	13.7	0.0	-9.5	-12.7	0.0	0.0	0.0	4.8	
연기금+국가자차체	85.6	-10.7	74.9	3.9	-0.5	-11.8	0.0	0.0	0.0	11.5	
기타법인	0.1	-2.0	-2.0	0.0	0.2	-7.7	-0.2	-0.1	-0.1	-2.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	679,300	263.2	673,571	18.1%	지수옵션 전체	1,400,522	520.9	1,874,055
Put	721,222	257.7	1,200,484	20.1%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	21.90%(-0.64%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	2.50	0.16	72,151	10,239	9	18.0	Put	317.5(K+1)	7.00	-0.95	1,513	4,308	139	18.5
	320.0(K+2)	3.43	0.25	51,510	9,082	-97	18.5		315.0(K+0)	5.62	-1.06	7,790	6,305	298	18.5
	317.5(K+1)	4.53	0.35	17,046	8,206	297	19.0		312.5(K-1)	4.62	-0.96	12,111	5,334	-258	19.1
	315.0(K+0)	5.84	0.45	12,825	6,250	573	19.5		310.0(K-2)	3.78	-0.85	17,786	7,784	263	19.8
	312.5(K-1)	7.34	0.57	4,696	3,430	-15	20.2		307.5(K-3)	3.08	-0.74	20,631	5,925	247	20.4

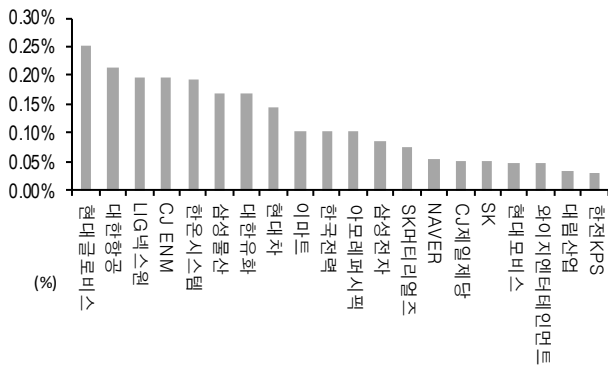
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,644,153	2,419.1	5,826,847	59,138	-28,805	42,829	4,942	-4.5	19.2	-11.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,400	0.50	566.4	101.1	1,453,343	-7,028	0.09%	-21,385	1,117	19,957	8,343	-3,064
삼성 SDI	424,500	-1.16	56.4	92.4	11,712	-409	-0.06%	35	-19	-32	-40	371
현대차	167,500	2.76	250.7	80.0	79,698	2,719	0.14%	-197	563	160	-4,903	2,077
기아차	46,300	1.98	63.3	74.2	89,897	4,876	0.03%	-1,244	4,458	-3,219	-2,196	-3,001
POSCO	219,000	4.04	143.4	73.0	27,142	-267	-0.04%	1,140	1,237	-2,316	-1,281	-77
SK 하이닉스	84,200	1.32	158.7	72.6	202,714	5,288	-0.01%	2,872	1,046	-4,208	45	-5,150
대림산업	83,300	2.08	20.2	66.7	27,596	2,309	0.03%	277	1,257	-1,533	-583	-1,510
현대모비스	236,000	0.43	55.9	63.9	35,534	-612	0.05%	-457	-211	670	-722	1,409
현대건설	31,600	-0.78	14.9	61.1	15,613	3,457	-0.09%	4,631	-161	-4,500	-2,193	-3,392
한화솔루션	44,500	-0.45	83.3	59.9	79,927	-1,061	-0.04%	-2,143	-657	2,802	3,904	4,440

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터