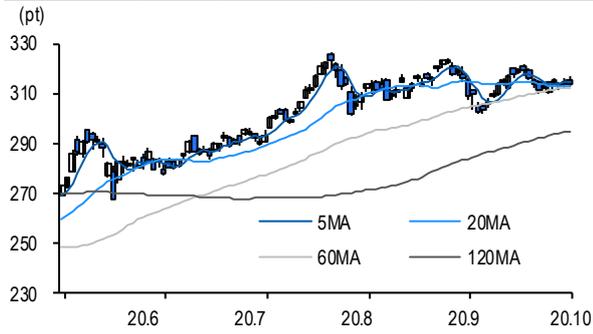


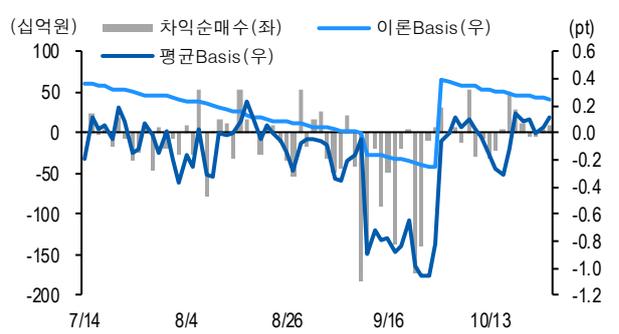


선물옵션시장 지표 2020.10.27

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.53	-0.40	-1.26	8,033.3	-
선물 12월물	313.80	-0.48	-1.50	16,543.9	284,742
선물 3월물	309.40	-0.34	-1.05	17.8	14,461
11월물(mini)	313.68	-0.47	-1.48	1,818.1	85,484
12월물(mini)	313.72	-0.50	-1.26	77.3	34,401

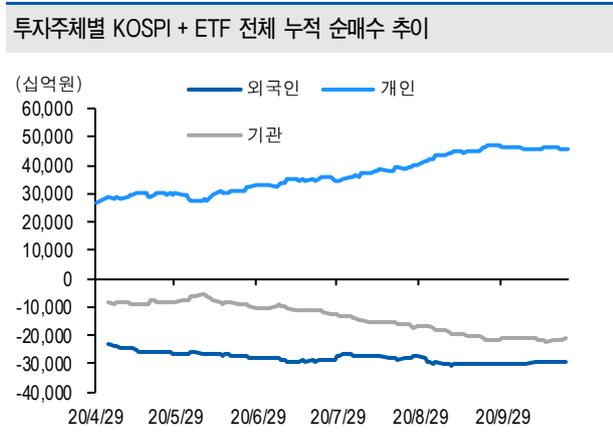


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.24	0.12	0.27	-0.04%	
베이스스(mini)	0.09	0.08	0.15	0.00%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.50	-4.50	-0.33%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.09	0.18	0.18	0.03%	

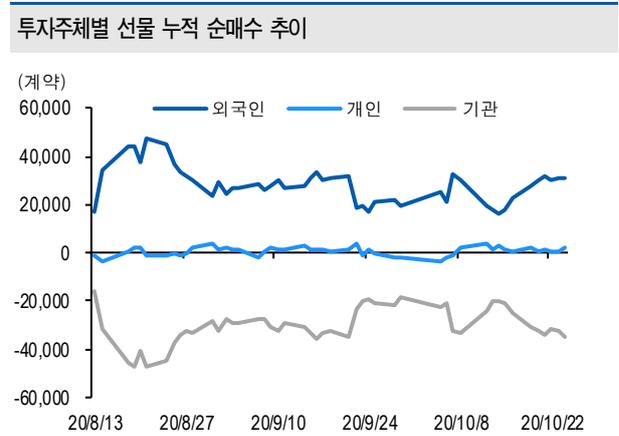


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-118.2	-12.6	-130.8	2.7	-134.2	39.7	-40.8	0.0	-0.2	2.5	
개인	-111.1	105.9	-5.1	0.0	0.9	171.5	1.1	0.7	-0.2	-21.1	
기관	244.6	-97.4	147.3	6.4	-16.0	-213.4	38.5	-0.3	0.4	18.1	
금융투자	56.3	-75.1	-18.8	0.0	3.7	35.5	38.5	0.1	0.6	6.0	
투신	71.9	-43.2	28.7	0.0	2.2	-267.1	-0.1	-0.4	-0.1	-4.2	
은행+보험+기타금융	30.8	19.5	50.3	0.0	-2.7	30.3	0.0	-0.1	0.0	2.8	
연기금+국가지자체	72.2	0.3	72.5	6.4	-3.9	-12.1	0.0	0.0	0.0	13.4	
기타법인	-15.4	4.0	-11.4	0.0	-0.5	2.1	1.2	-0.4	0.0	0.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

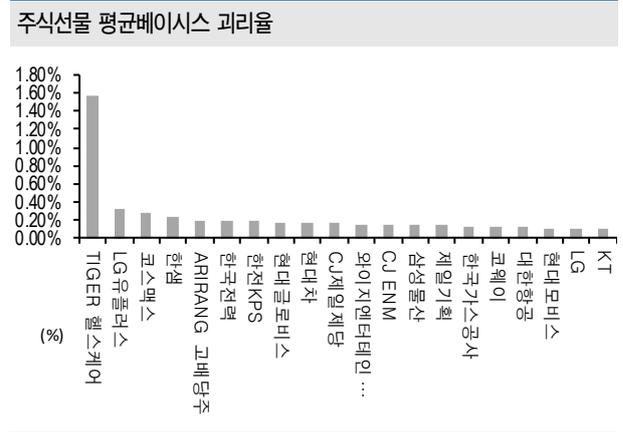
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	570,072	184.5	692,205	18.6%	지수옵션 전체	1,182,376	378.7	1,941,927
Put	612,304	194.1	1,249,722	21.3%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	22.94%(+1.04%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.94	-0.56	60,219	11,150	911	18.5	Put	317.5(K+1)	7.49	0.49	1,151	4,420	112	19.1
	320.0(K+2)	2.73	-0.70	35,304	10,389	1,307	19.0		315.0(K+0)	6.19	0.57	7,313	6,149	-156	19.7
	317.5(K+1)	3.70	-0.83	12,507	8,339	133	19.4		312.5(K-1)	5.07	0.45	12,194	5,375	41	20.3
	315.0(K+0)	4.90	-0.94	10,848	8,682	2,432	20.0		310.0(K-2)	4.13	0.35	18,782	7,860	76	20.9
	312.5(K-1)	6.28	-1.06	1,671	3,574	144	20.6		307.5(K-3)	3.37	0.29	22,869	6,221	296	21.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	4,532,299	3,493.4	5,835,384	8,537	-1,523	-12,011	14,751	2.5	-21.1	18.1		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대림산업	82,700	-0.72	30.5	137.8	35,649	8,053	0.05%	-2,971	1,130	1,788	2,470	-5,188
삼성전자	60,500	0.17	1,016.0	126.7	1,457,579	4,236	0.00%	16,611	-13,451	-3,107	-5,404	10,549
기아차	48,150	4.00	130.5	91.0	122,369	32,472	0.05%	1,457	2,611	-4,032	-5,058	-17,351
SK 하이닉스	83,600	-0.71	123.9	90.9	203,463	749	-0.05%	-2,682	-359	3,819	1,296	1,227
현대차	171,500	2.39	463.4	90.8	86,679	6,981	0.16%	1,047	-1,407	354	-3,783	-742
삼성 SDI	418,000	-1.53	57.4	79.3	11,418	-294	-0.03%	175	130	-318	-96	50
롯데케미칼	238,000	-4.61	68.0	67.6	19,186	-1,650	0.07%	-195	1,247	-1,307	-1,241	396
한화솔루션	42,000	-5.62	94.9	65.0	86,138	6,211	-0.03%	8,495	1,316	-9,370	-3,638	-3,905
하나금융지주	32,600	-1.21	56.0	62.8	155,776	-63,235	-0.07%	-7,438	-1,325	8,198	14,916	37,934
KB 금융	42,350	0.24	51.5	61.4	92,635	-17,576	-0.05%	-308	-3,681	4,055	3,265	13,022

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터