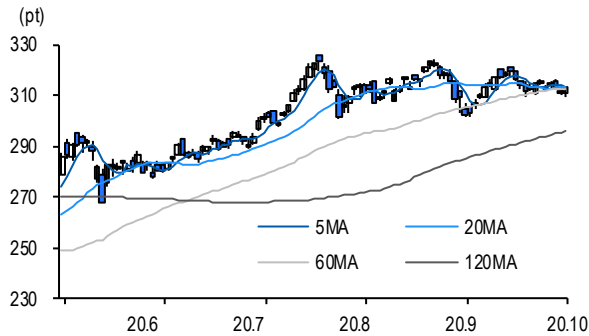


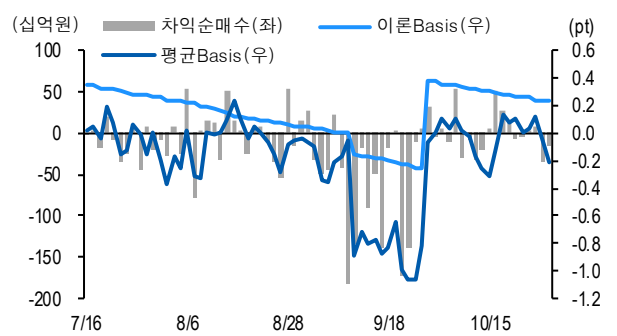


선물옵션시장 지표 2020.10.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.17	0.44	1.37	5,461.0	-
선물 12월물	313.10	0.64	2.00	16,292.0	289,291
선물 3월물	308.70	0.64	1.95	18.5	14,777
11월물(mini)	313.22	0.64	2.00	1,883.1	79,771
12월물(mini)	313.42	0.75	1.90	101.5	40,167

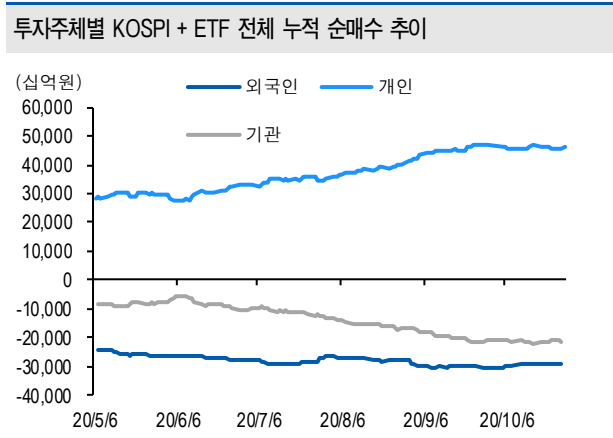


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.23	-0.21	-0.07	-0.14%
베이스(mini)	0.08	-0.15	0.05	-0.07%
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.44	-4.45	-0.32%
합성선물 베이스(ATM)	0.08	0.01	0.01	-0.02%

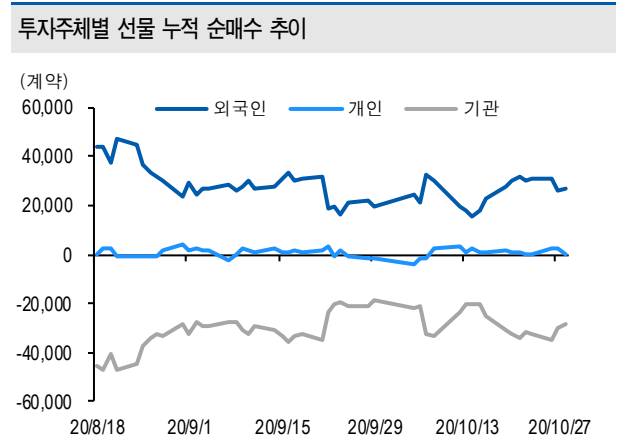


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	13.5	5.8	19.2	0.0	-91.7	221.1	-160.3	0.7	-1.5	-10.3
개인	151.9	12.0	164.0	0.0	3.4	-145.1	-39.4	-1.6	0.9	16.2
기관	-175.1	-19.8	-194.9	-16.8	-34.7	-63.1	200.7	1.0	0.8	-6.6
금융투자	-157.7	-10.5	-168.2	0.0	-1.1	-273.6	200.9	1.4	1.1	23.8
투신	16.1	0.9	17.1	0.0	-7.0	158.4	-0.3	-0.5	0.1	16.9
은행+보험+기타금융	-40.1	4.4	-35.7	0.0	-30.3	36.3	0.0	0.0	-0.4	-0.3
연기금+국가자자체	-15.3	-12.3	-27.6	-16.8	-2.0	15.8	0.0	0.0	0.0	-47.1
기타법인	9.8	2.0	11.7	0.0	0.4	-12.9	-0.9	0.0	-0.2	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





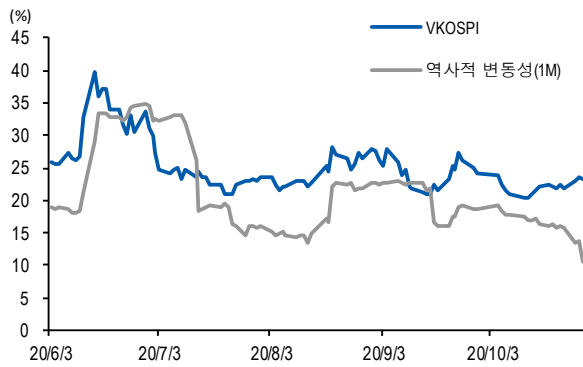
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	588,030	192.6	726,951	19.3%	지수옵션 전체	1,145,640	386.4	2,055,869
Put	557,610	193.9	1,328,918	22.8%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	23.29%(-0.29%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	2.40	0.44	75,046	13,100	1,185	19.2	Put	315.0(K+1)	6.29	-1.17	1,672	6,076	159	20.5
	317.5(K+2)	3.32	0.61	54,595	8,226	510	19.6		312.5(K+0)	5.14	-1.03	4,333	5,032	-370	21.1
	315.0(K+1)	4.47	0.76	30,732	8,969	-25	20.2		310.0(K-1)	4.18	-0.87	13,747	8,505	-65	21.8
	312.5(K+0)	5.82	0.97	9,920	4,554	828	20.8		307.5(K-2)	3.39	-0.73	12,131	6,345	-33	22.5
	310.0(K-1)	7.37	1.13	4,726	5,482	278	21.5		305.0(K-3)	2.73	-0.58	22,961	13,491	712	23.1

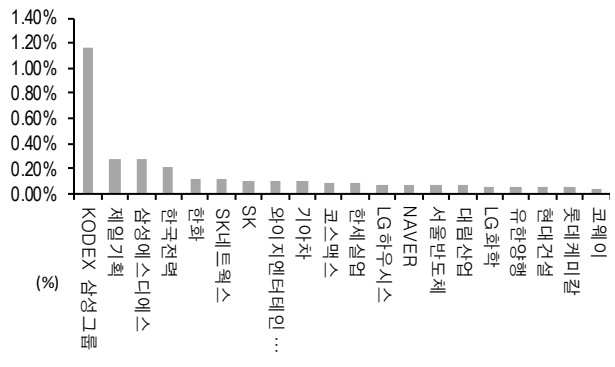
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,277,776	2,622.6	5,705,277	34,924	19,143	10,554	-32,202	-10.3	16.2	-6.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	162,000	4.52	25.0	98.4	19,009	7,025	0.02%	-373	682	-288	904	-3,802
카카오	346,000	4.06	199.8	93.7	32,082	1,398	-0.17%	-170	1,327	-1,183	-651	-3,688
삼성전자	59,100	-1.17	701.5	83.1	1,343,329	-15,972	-0.04%	5,909	22,132	-30,242	24,474	-19,060
SK 하이닉스	82,800	0.24	119.8	82.0	168,034	-6,315	-0.06%	-1,069	-1,558	2,583	4,476	609
현대모비스	253,500	3.68	95.3	79.9	42,273	7,181	0.04%	-2,358	-919	3,283	517	-3,361
NAVER	300,000	6.19	161.0	79.1	38,906	7,103	0.07%	287	1,078	-1,341	-3,331	-2,499
현대차	174,000	1.16	190.9	79.1	76,172	-797	-0.07%	2,104	1,487	-3,619	2,121	-3,148
삼성 SDI	428,000	-0.23	81.1	73.8	12,768	-1,614	-0.07%	-1,747	526	1,528	418	2,413
한화솔루션	46,100	4.18	147.3	65.8	90,173	4,589	-0.02%	-5,359	-1,427	6,745	2,582	-5,765
롯데케미칼	247,000	6.24	66.6	64.8	22,394	1,093	0.05%	405	-1,029	603	-1,046	518

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터