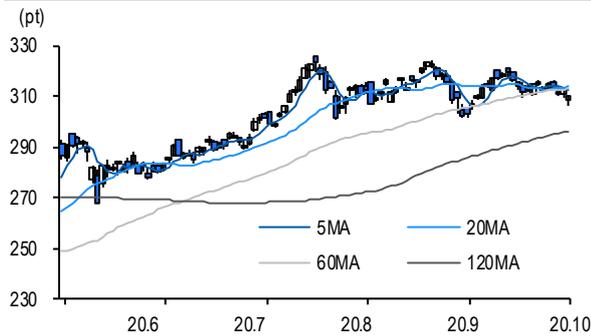


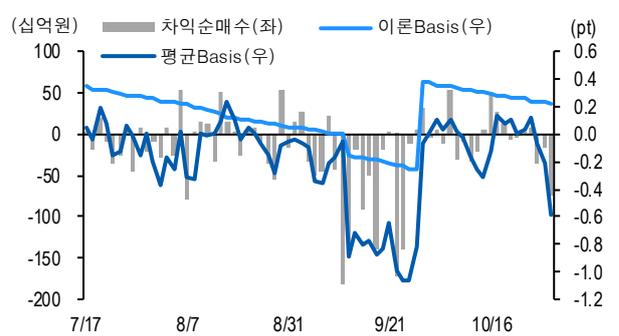


선물옵션시장 지표 2020.10.30

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.94	-1.03	-3.23	6,888.9	-
선물 12월물	309.20	-1.25	-3.90	24,343.1	284,897
선물 3월물	305.05	-1.18	-3.65	24.9	14,897
11월물(mini)	309.46	-1.20	-3.76	3,032.1	71,280
12월물(mini)	309.96	-1.00	-3.46	135.2	47,031

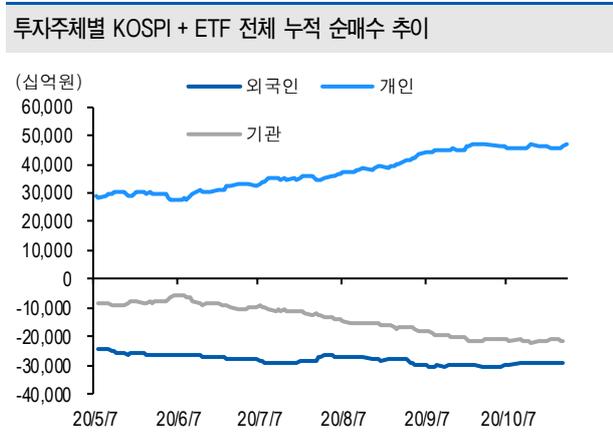


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.22	-0.59	-0.74	-0.26%	
베이스(mini)	0.07	-0.37	-0.48	-0.14%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.33	-4.20	-0.28%	
합성선물 베이스(ATM)	0.07	-0.48	-0.48	-0.18%	

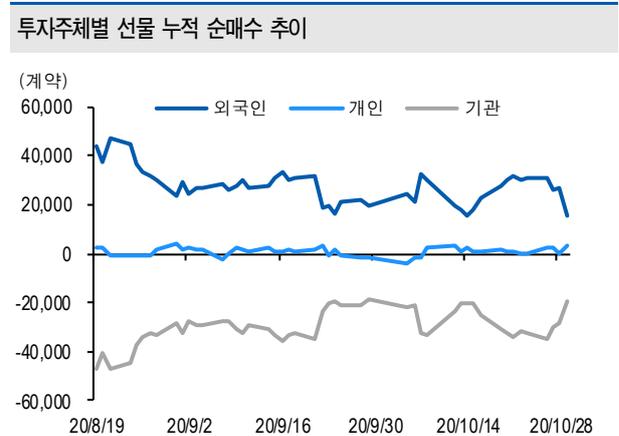


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-535.6	8.3	-527.2	0.0	-398.6	-608.0	-289.8	-4.5	7.6	-45.9	
개인	978.4	-45.3	933.1	0.0	2.7	207.2	12.8	1.6	1.2	22.5	
기관	-475.5	36.7	-438.8	-73.1	-5.1	390.9	276.2	2.9	-8.7	24.1	
금융투자	-398.6	-15.9	-414.5	-20.1	-12.8	581.8	275.5	2.0	-7.5	27.9	
투신	-0.2	30.3	30.1	0.0	7.0	-296.2	0.6	-0.3	-0.3	-22.2	
은행+보험+기타금융	11.8	30.4	42.3	0.0	9.1	53.7	0.2	1.3	-0.9	-0.2	
연기금+국가자재	-65.2	-0.2	-65.5	-52.9	7.6	51.6	0.0	0.0	0.0	18.6	
기타법인	32.7	0.2	33.0	0.0	-1.6	9.8	0.8	-0.1	0.0	-0.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	731,781	232.2	754,076	20.2%	지수옵션 전체	1,768,756	604.3	2,108,654
Put	1,036,975	372.1	1,354,578	25.4%	PCR(금액기준)	1.60	VKOSPI	25.90%(+2.61%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.58	-0.82	114,189	17,595	4,495	20.0	Put	315.0(K+1)	8.66	2.37	1,655	6,039	-37	23.1
	317.5(K+2)	2.27	-1.05	65,764	12,035	3,809	20.4		312.5(K+0)	7.29	2.15	4,085	4,823	-209	23.7
	315.0(K+1)	3.15	-1.32	56,989	11,318	2,349	20.9		310.0(K-1)	6.07	1.89	7,761	8,412	-93	24.3
	312.5(K+0)	4.25	-1.57	26,167	5,735	1,181	21.5		307.5(K-2)	5.05	1.66	15,115	6,635	290	25.0
	310.0(K-1)	5.52	-1.85	11,292	7,249	1,767	22.0		305.0(K-3)	4.19	1.46	23,233	12,689	-802	25.7

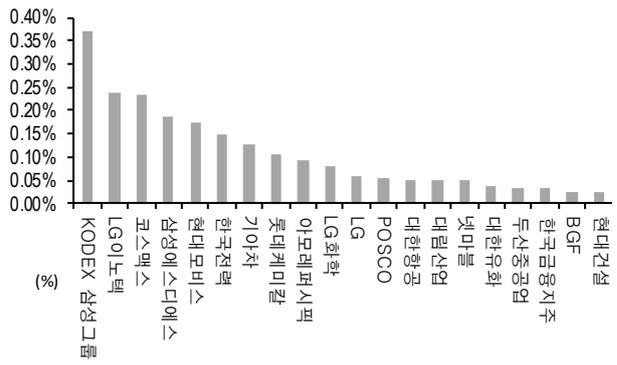
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,116,188	3,124.7	5,609,148	-96,129	-87,534	21,795	66,622	-45.9	22.5	24.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한화솔루션	45,700	-0.87	136.8	88.6	97,798	7,625	0.00%	-1,332	861	365	-8,248	497
카카오	342,000	-1.16	135.6	81.5	31,490	-592	-0.12%	-1,714	486	1,208	1,175	193
삼성전자	58,200	-1.52	1,051.0	80.7	1,249,460	-93,869	-0.13%	-20,978	-3,505	26,713	45,779	48,206
LG 화학	652,000	1.56	173.3	74.4	24,478	3,598	0.08%	753	234	-1,001	-452	-3,213
NAVER	299,000	-0.33	172.7	73.9	39,164	258	0.01%	-954	925	-4	-864	1,096
삼성 SDI	430,500	0.58	77.8	70.1	13,252	484	-0.05%	625	182	-791	-96	-712
현대모비스	238,500	-5.92	114.8	68.3	44,608	2,335	0.17%	-2,059	1,159	952	742	-1,358
LG 이노텍	158,500	-2.16	12.7	67.7	19,122	113	0.24%	-115	-109	221	529	-477
SK 하이닉스	81,500	-1.57	139.6	67.5	158,730	-9,304	-0.13%	-3,671	-2,953	6,614	14,496	-2,211
현대차	170,000	-2.30	168.5	67.3	67,706	-8,466	-0.22%	117	-2,637	2,602	2,658	6,856

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터