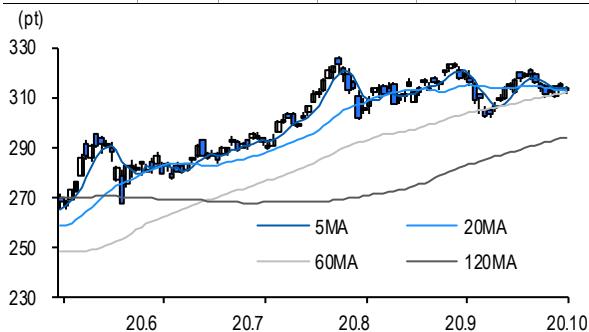


선물옵션시장 지표

2020.10.23

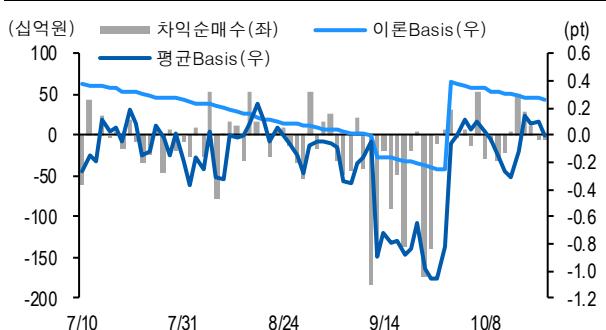
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.77	-0.63	-1.99	6,074.3	-
선물 12월물	313.70	-0.76	-2.40	19,932.7	282,830
선물 3월물	309.35	-0.63	-1.95	17.4	14,054
11월물(mini)	313.72	-0.72	-2.26	2,515.1	81,939
12월물(mini)	313.60	-0.79	-2.40	186.2	29,372



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.27	0.00	-0.07	-0.08%
베이시스(mini)	0.11	0.01	-0.05	-0.03%
제1스프레드(SP)	-3.44	-4.38	-4.45	-0.30%
합성선물 베이시스(ATM)	0.11	-0.06	-0.06	-0.06%



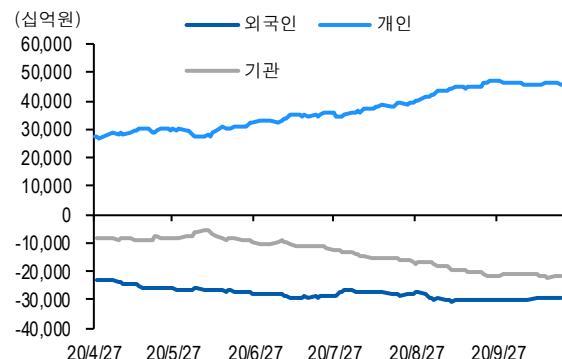
투자주체별 매매 동향

(십억원)

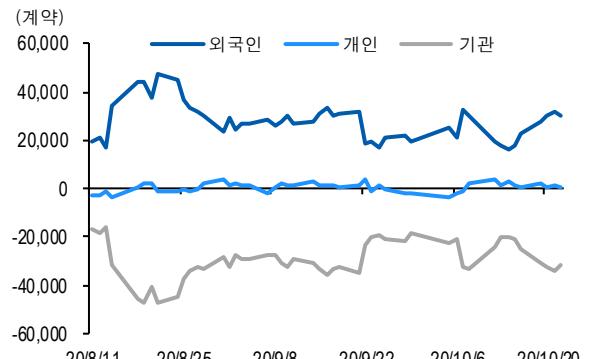
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-73.5	-10.4	-83.9	0.0	-25.5	19.0	-143.4	2.2	-2.6	0.1
개인	67.0	57.2	124.2	0.0	-0.2	-55.6	-12.5	-1.1	0.1	-3.9
기관	8.1	-48.9	-40.8	-4.7	-55.5	66.5	156.5	-1.2	2.7	3.9
금융투자	43.8	-35.2	8.5	0.0	-0.8	219.3	156.8	1.0	0.2	1.1
투신	-46.7	-33.6	-80.4	0.0	-41.1	-208.2	-0.3	-0.7	0.0	-8.6
은행+보험+기타금융	31.2	15.9	47.1	0.0	3.2	51.9	0.0	-1.5	2.5	1.8
연기금+국가지자체	-13.1	1.3	-11.8	-4.7	-8.2	3.5	0.0	0.0	0.0	9.6
기타법인	-1.6	2.1	0.5	0.0	0.0	-29.9	-0.5	0.0	-0.1	0.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	607,674	204.0	664,221	18.2%	지수옵션 전체	1,243,493	439.0	1,817,902							
Put	635,819	235.0	1,153,681	21.2%	PCR(금액기준)	1.15	VKOSPI	22.54%(+0.66%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성
Call	322.5(K+3)	2.34	-0.81	65,061	10,230	817	18.1	Put	317.5(K+1)	7.95	1.17	3,459	4,169	4	19.3
	320.0(K+2)	3.18	-0.97	36,264	9,179	-154	18.4		315.0(K+0)	6.68	1.05	3,433	6,007	20	19.8
	317.5(K+1)	4.18	-1.15	17,010	7,909	1,106	18.8		312.5(K-1)	5.58	0.90	9,425	5,592	770	20.4
	315.0(K+0)	5.39	-1.33	9,441	5,677	284	19.3		310.0(K-2)	4.63	0.76	9,996	7,521	65	20.9
	312.5(K-1)	6.77	-1.48	5,839	3,445	543	19.7		307.5(K-3)	3.82	0.63	12,532	5,678	172	21.4

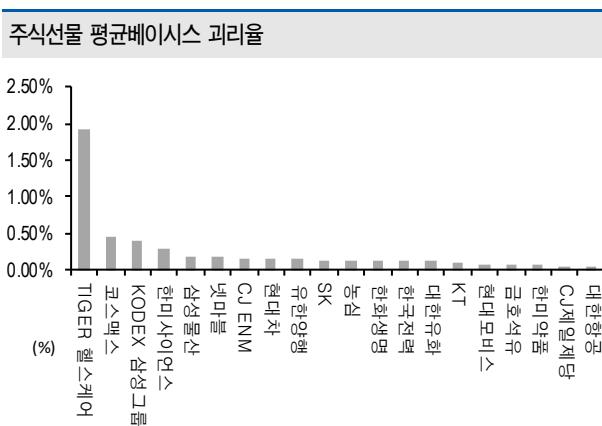
---

자료: KRX, 유안티증권 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	3,567,467	2,577.2	5,767,709	38,161	-6,400	11,909	-4,652	0.1	-3.9	3.9		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,100	-1.48	732.3	91.1	1,460,371	-1,917	0.04%	11,974	1,830	-13,945	-14,656	-3,550
카카오	348,000	-1.83	117.0	89.7	27,450	-1,043	-0.30%	-1,319	-173	1,436	-90	1,536
삼성 SDI	429,500	-1.26	72.9	87.9	12,121	369	-0.05%	-2	88	-214	94	-327
LG 전자	88,100	-2.22	37.5	70.9	24,694	3,889	-0.40%	2,200	-3,518	1,162	1,112	121
SK 하이닉스	83,100	-1.07	141.7	69.3	197,426	-8,519	-0.03%	-3,380	8	3,356	2,387	7,162
기아차	45,400	0.00	50.7	68.8	85,021	1,997	0.03%	-1,705	1,743	-83	1,439	-3,332
대림산업	81,600	1.75	22.8	67.3	25,287	-77	0.00%	233	-1,150	856	-439	772
NAVER	294,000	-1.34	79.8	65.8	30,566	130	0.03%	779	-147	-636	496	-1,184
LG 화학	640,000	3.73	209.8	64.7	21,964	-1,567	0.04%	-356	-668	1,086	112	763
현대모비스	235,000	1.08	55.3	64.5	36,146	2,551	0.09%	753	152	-899	-368	-1,582

---

자료: KBX 유티즌워리리서치센터