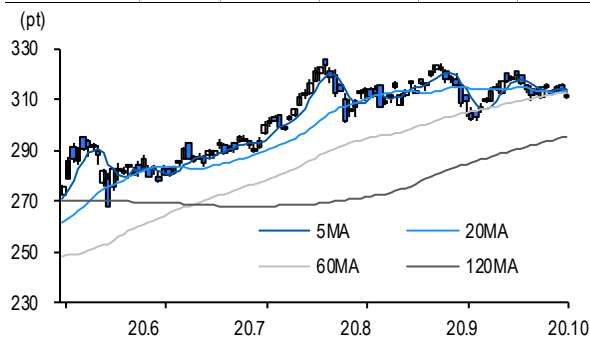


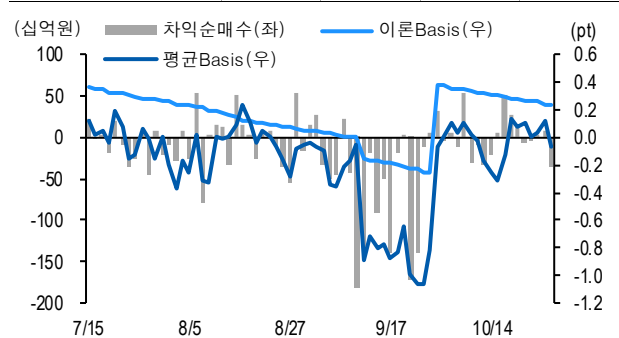
선물옵션시장 지표

2020.10.28

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.80	-0.55	-1.73	8,142.7	-
선물 12월물	311.10	-0.86	-2.70	17,989.7	286,389
선물 3월물	306.75	-0.86	-2.65	29.2	14,424
11월물(mini)	311.22	-0.78	-2.46	2,303.2	82,163
12월물(mini)	311.52	-0.73	-2.20	12.0	34,497

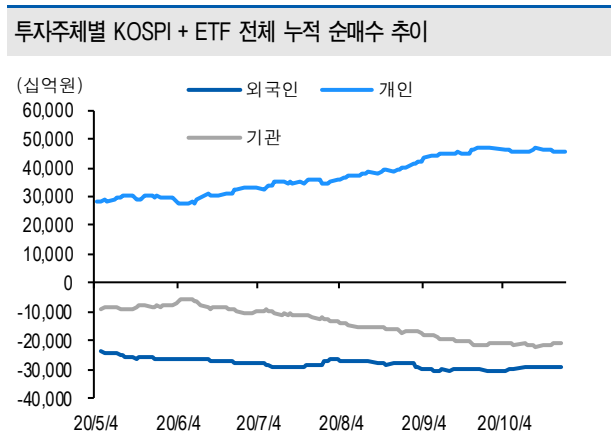


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.24	-0.06	-0.70	-0.10%
베이스(mini)	0.09	-0.08	-0.58	-0.05%
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.40	-4.40	-0.30%
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.62	-0.62	-0.23%

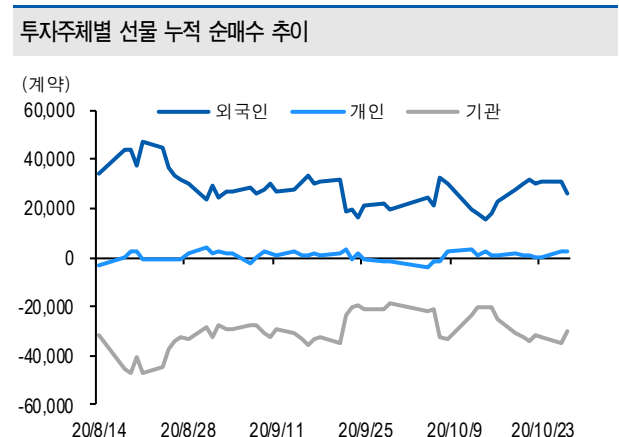


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	104.6	27.3	131.9	0.1	-1.1	-208.4	-177.6	-2.9	2.4	1.2
개인	106.9	-26.5	80.5	0.0	3.2	35.9	0.7	-0.3	-0.2	14.0
기관	-249.7	-3.8	-253.5	-36.0	-1.2	161.3	177.1	3.5	-2.3	-16.9
금융투자	-230.5	-81.5	-312.0	0.0	-1.6	186.2	177.1	1.6	-0.4	3.0
투신	6.2	83.9	90.1	0.0	-8.0	-84.6	-0.1	0.1	0.2	-53.3
은행+보험+기타금융	14.2	-3.1	11.1	0.0	2.0	20.3	0.1	1.9	-2.2	0.5
연기금+국가자재	-25.6	-0.5	-26.1	-36.0	2.0	39.4	0.0	0.0	0.0	32.9
기타법인	38.1	3.0	41.1	0.0	0.1	11.1	-0.3	-0.3	0.1	1.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	630,085	187.7	707,684	18.3%	지수옵션 전체	1,360,375	425.6	2,013,158
Put	730,290	237.9	1,305,474	22.9%	PCR(금액기준)	1.27	VKOSPI	23.58%(+0.64%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.96	-0.77	62,326	11,915	1,526	18.4	Put	315.0(K+1)	7.46	1.27	3,154	5,917	-232	21.4
	317.5(K+2)	2.71	-0.99	39,842	7,716	-623	18.5		312.5(K+0)	6.17	1.10	7,006	5,402	27	21.8
	315.0(K+1)	3.71	-1.19	15,725	8,994	312	19.0		310.0(K-1)	5.05	0.92	14,117	8,570	710	22.2
	312.5(K+0)	4.85	-1.43	5,338	3,726	152	19.2		307.5(K-2)	4.12	0.75	15,113	6,378	157	22.8
	310.0(K-1)	6.24	-1.79	2,922	5,204	167	19.6		305.0(K-3)	3.31	0.56	25,773	12,779	572	23.2

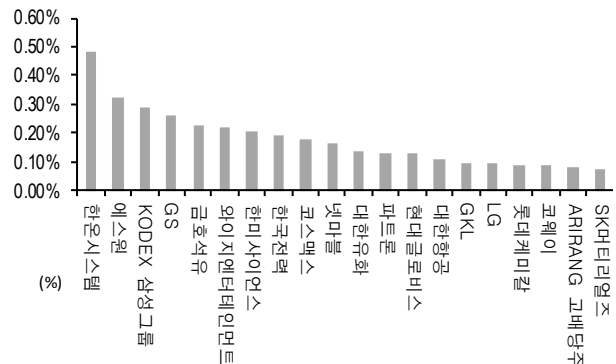
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,762,733	3,733.5	5,670,353	-165,031	-3,233	21,573	-22,179	1.2	14.0	-16.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대림산업	81,400	-1.57	21.9	114.5	35,540	-109	0.05%	625	-755	119	1,091	-474
삼성 SDI	429,000	2.63	168.7	99.4	14,382	2,964	-0.01%	1,001	-4	-953	-749	-2,645
LG 화학	631,000	-2.47	154.3	93.2	21,657	-16	0.04%	-195	-105	338	121	-3
현대차	172,000	0.29	520.4	89.9	76,969	-9,710	-0.08%	-2,574	448	1,782	1,211	8,450
삼성전자	59,800	-1.16	919.8	89.1	1,359,301	-98,278	-0.01%	-2,007	19,079	-16,262	10,990	64,647
SK 하이닉스	82,600	-1.20	146.4	78.2	174,349	-29,114	-0.04%	1,209	2,096	-3,339	2,124	10,537
카카오	332,500	1.37	207.6	75.9	30,684	2,011	-0.23%	814	827	-1,731	-512	-2,339
한화솔루션	44,250	5.36	167.1	73.7	85,584	-554	-0.02%	3,873	-2,572	-1,207	1,378	-4,617
현대모비스	244,500	0.20	133.3	67.5	35,092	-3,162	0.03%	-322	111	192	-504	2,197
롯데케미칼	232,500	-2.31	57.7	65.6	21,301	2,115	0.09%	43	614	-564	-1,196	-1,032

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터