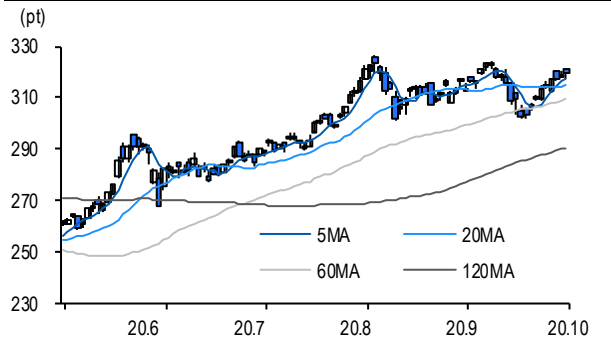


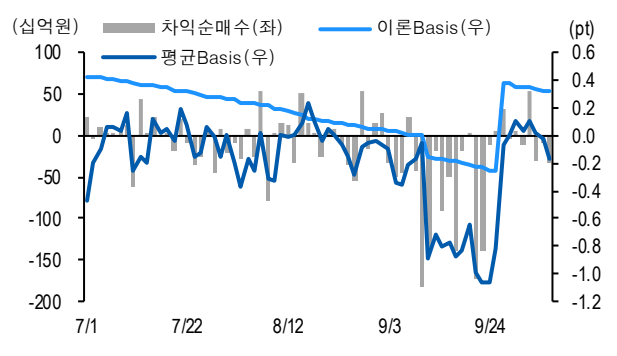


선물옵션시장 지표 2020.10.14

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.58	0.13	0.43	6,466.7	-
선물 12월물	318.80	-0.16	-0.50	18,577.5	274,521
선물 3월물	314.70	-0.16	-0.50	19.1	8,681
11월물(mini)	318.88	-0.13	-0.40	2,219.9	46,361
12월물(mini)	319.26	-0.01	0.06	74.7	9,745

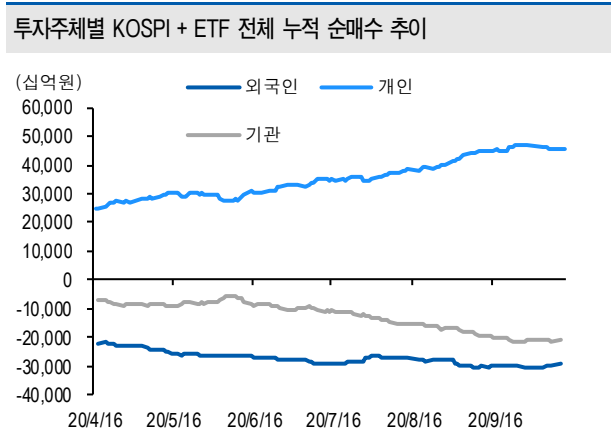


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.32	-0.17	-0.78	-0.15%
베이스(mini)	0.17	-0.02	-0.70	-0.06%
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.17	-4.20	-0.22%
합성선물 베이스(ATM)	0.17	-0.63	-0.63	-0.25%

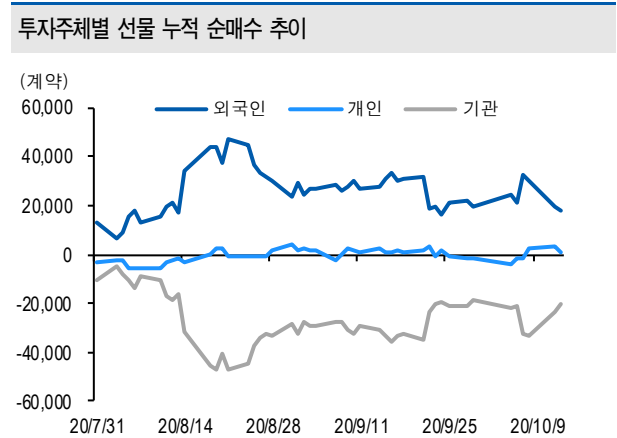


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	209.8	-34.7	175.1	0.0	97.7	40.8	-135.9	-2.6	-0.2	10.7
개인	-32.7	27.1	-5.6	0.0	-1.9	-182.2	-13.7	2.0	-1.3	27.1
기관	-174.0	5.4	-168.6	-32.2	-97.5	140.0	149.3	0.7	1.9	-39.3
금융투자	-112.0	50.1	-61.9	0.0	-13.4	221.7	149.2	0.7	1.8	-52.6
투신	-1.5	-31.9	-33.4	0.0	-9.7	-77.0	0.2	0.0	0.1	28.1
은행+보험+기타금융	-6.4	-7.2	-13.6	0.0	-10.2	-37.4	0.0	0.0	0.0	0.5
연기금+국가자재	-51.7	-6.9	-58.6	-32.2	-65.7	32.8	0.0	0.0	0.0	-15.3
기타법인	-3.1	2.2	-0.9	0.0	-0.1	1.3	0.3	-0.2	-0.4	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	453,739	185.5	517,516	16.7%	지수옵션 전체	1,091,718	411.4	1,421,480
Put	637,979	225.9	903,964	20.2%	PCR(금액기준)	1.22	VKOSPI	20.34%(-0.02%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	3.17	-0.20	34,629	6,532	731	16.8	Put	322.5(K+1)	8.67	-0.10	839	753	168	19.3
	325.0(K+2)	4.03	-0.26	16,482	5,043	382	16.8		320.0(K+0)	7.32	0.07	2,880	3,097	162	19.4
	322.5(K+1)	5.03	-0.33	10,142	2,409	468	16.9		317.5(K-1)	6.20	0.06	5,618	3,717	709	19.6
	320.0(K+0)	6.27	-0.35	5,967	3,692	572	17.2		315.0(K-2)	5.21	0.02	9,390	4,134	1,052	19.9
	317.5(K-1)	7.62	-0.38	2,619	4,662	109	17.4		312.5(K-3)	4.38	-0.01	10,093	2,572	960	20.3

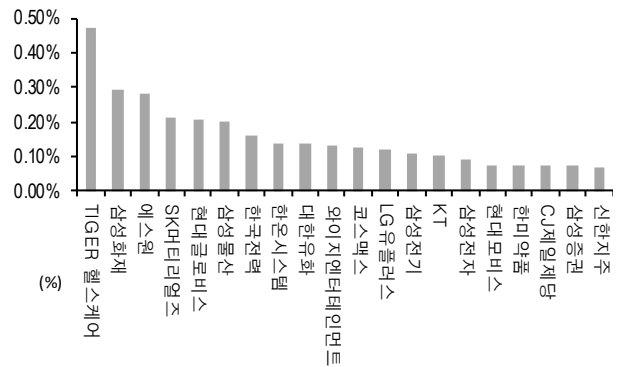
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,362,346	3,217.3	5,318,280	235,644	-24,604	65,647	-48,175	10.7	27.1	-39.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,800	0.33	1,152.7	98.6	1,397,855	91,927	0.09%	-15,706	31,452	-19,368	-45,728	-12,042
기아차	50,300	1.00	91.1	80.3	112,832	-5,213	0.03%	4,924	715	-5,643	-7,684	-415
NAVER	295,000	1.03	150.4	80.2	31,834	-519	-0.05%	1,430	319	-1,780	-3,423	2,207
카카오	373,000	0.40	76.4	67.9	27,402	-2,286	-0.20%	869	79	-936	-373	-670
현대차	179,000	-0.56	207.1	67.5	82,669	1,225	0.03%	1,588	-302	-1,128	848	-3,473
LG 전자	91,500	-0.11	62.9	67.0	24,244	-4,757	-0.24%	2,154	-2,943	1,051	-4,134	-3,295
삼성생명	60,700	-1.30	13.7	61.7	11,690	-5,415	-0.76%	2,162	470	-2,641	5,813	1,512
SK 하이닉스	88,300	3.15	335.2	61.1	242,386	57,055	0.06%	7,605	6,706	-13,846	-25,460	-12,942
한화솔루션	47,500	-3.26	166.7	59.6	94,843	-1,681	-0.01%	2,968	5,129	-8,133	222	-5,434
호텔신라	76,800	-1.41	18.9	55.2	11,665	-3,791	-0.06%	-2,378	-1,926	4,301	1,218	3,123

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터