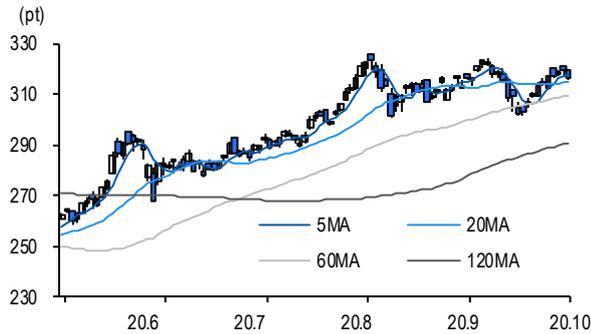


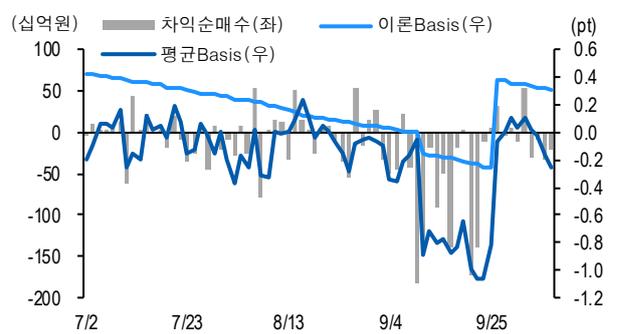


선물옵션시장 지표 2020.10.15

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.57	-0.94	-3.01	6,272.9	-
선물 12월물	316.10	-0.85	-2.70	20,087.5	279,879
선물 3월물	311.80	-0.92	-2.90	15.4	10,039
11월물(mini)	316.28	-0.82	-2.60	2,321.8	50,426
12월물(mini)	316.02	-0.87	-3.24	32.4	10,940

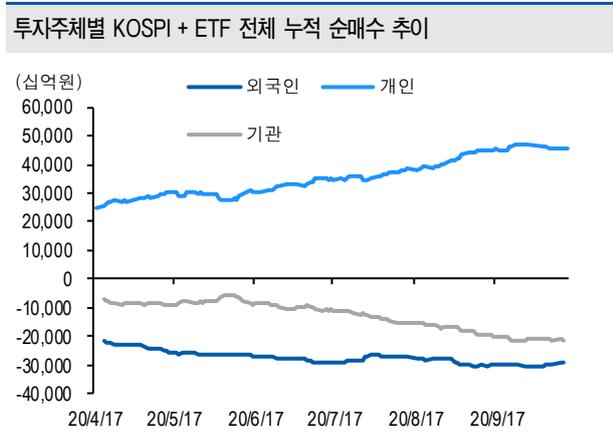


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.31	-0.26	-0.47	-0.18%
베이스(mini)	0.16	-0.09	-0.29	-0.08%
제1스프레드(SP)	-3.45	-4.24	-4.30	-0.25%
합성선물 베이스(ATM)	0.16	-0.31	-0.31	-0.15%

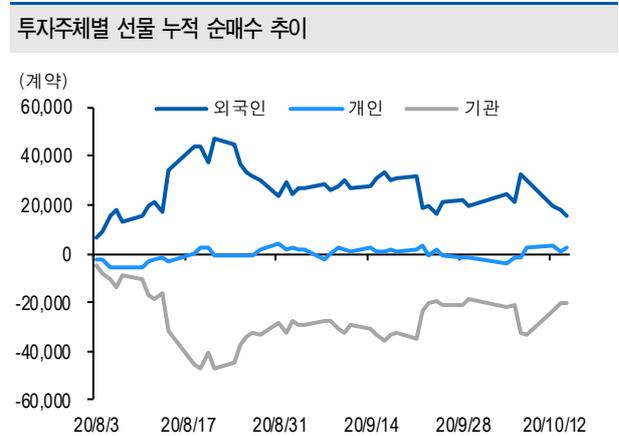


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-35.0	-10.7	-45.6	15.1	-26.6	-51.5	-129.4	-0.7	-0.1	-13.2
개인	412.2	15.9	428.1	0.0	0.4	119.6	15.7	1.3	-0.2	9.9
기관	-375.8	-7.5	-383.3	-36.5	-65.5	-82.2	113.1	0.1	0.7	3.3
금융투자	-95.9	-38.9	-134.8	0.0	-8.6	63.5	113.5	0.2	0.7	3.7
투신	-38.8	-0.5	-39.3	0.0	0.2	-194.8	-0.4	0.0	0.0	-35.8
은행+보험+기타금융	-35.1	30.0	-5.1	0.0	-7.0	-3.7	0.0	0.0	-0.1	3.4
연기금+국가자재	-172.5	-3.3	-175.8	-36.5	-49.2	52.9	0.0	0.0	0.0	32.0
기타법인	-1.4	2.3	0.8	0.0	-0.3	14.2	0.6	-0.6	-0.4	0.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	443,666	161.4	546,932	17.2%	지수옵션 전체	1,027,183	382.1	1,499,668
Put	583,517	220.7	952,736	20.0%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	20.97%(+0.63%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	2.32	-0.85	31,297	8,412	1,880	17.1	Put	322.5(K+1)	10.30	1.63	332	875	122	19.3
	325.0(K+2)	3.05	-0.98	24,804	6,424	1,381	17.3		320.0(K+0)	8.69	1.37	1,631	3,080	-17	19.1
	322.5(K+1)	3.93	-1.10	9,354	2,979	570	17.5		317.5(K-1)	7.39	1.19	5,876	4,252	535	19.3
	320.0(K+0)	4.95	-1.32	8,126	4,443	751	17.7		315.0(K-2)	6.26	1.05	9,474	4,966	832	19.6
	317.5(K-1)	6.17	-1.45	4,962	5,189	527	18.1		312.5(K-3)	5.28	0.90	8,717	2,617	45	20.0

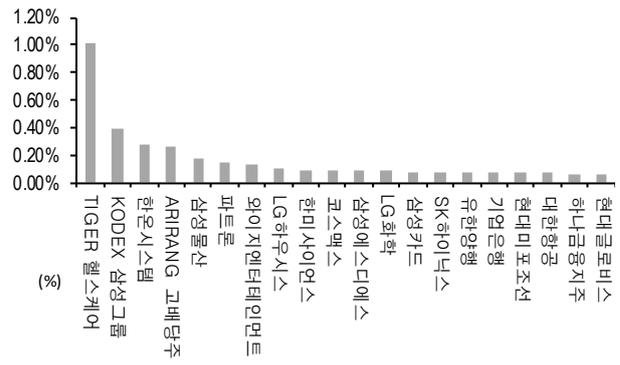
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,437,355	2,619.0	5,329,630	11,350	-69,974	6,162	60,250	-13.2	9.9	3.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	86,800	-1.70	230.1	87.8	235,237	-7,149	0.08%	-16,121	829	15,614	-1,694	10,244
삼성전자	60,900	0.16	717.8	83.8	1,406,601	8,746	0.01%	-24,651	10,580	14,908	-13,220	23,906
현대차	178,000	-0.56	254.9	76.0	71,799	-10,870	-0.07%	-1,427	47	1,436	54	8,364
LG 전자	91,300	-0.22	50.5	68.7	23,618	-626	-0.18%	-10	-204	222	695	-496
삼성 SDI	438,000	-1.79	75.7	65.1	12,794	-204	-0.05%	2,406	-130	-2,286	-53	-1,264
NAVER	298,000	1.02	123.3	64.3	34,163	2,329	0.02%	-105	655	-566	-891	-1,326
기아차	49,200	-2.19	58.8	64.3	83,460	-29,372	0.00%	-1,133	696	491	-6,209	24,015
삼성전기	141,000	-1.40	55.4	60.0	29,576	1,872	0.00%	136	-21	-108	-189	-754
한화솔루션	46,200	-2.74	139.4	58.9	88,293	-6,550	-0.01%	750	12,717	-13,472	-3,643	-2,377
카카오	368,000	-1.34	61.6	53.6	25,933	-1,469	-0.21%	1,044	92	-1,130	792	-211

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터