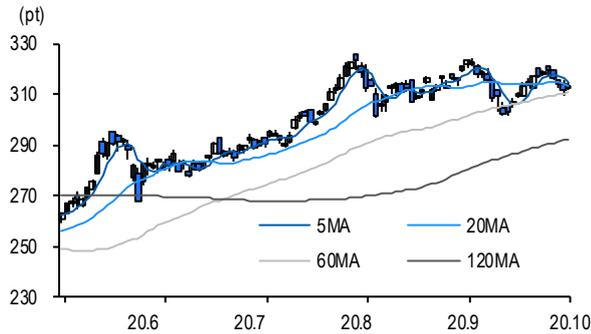


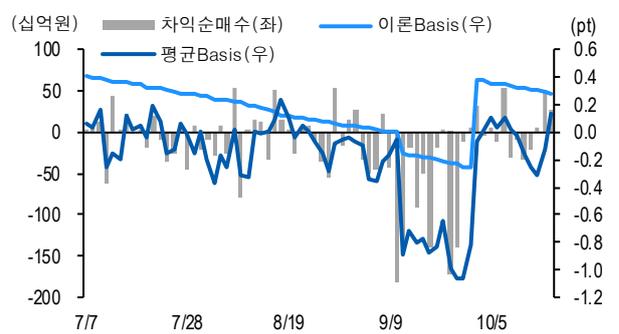


선물옵션시장 지표 2020.10.20

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.59	0.24	0.76	6,039.7	-
선물 12월물	312.45	0.10	0.30	17,082.9	282,282
선물 3월물	307.55	0.11	0.35	59.0	11,765
11월물(mini)	312.46	0.07	0.22	2,281.0	73,506
12월물(mini)	312.48	0.10	0.48	23.9	14,185

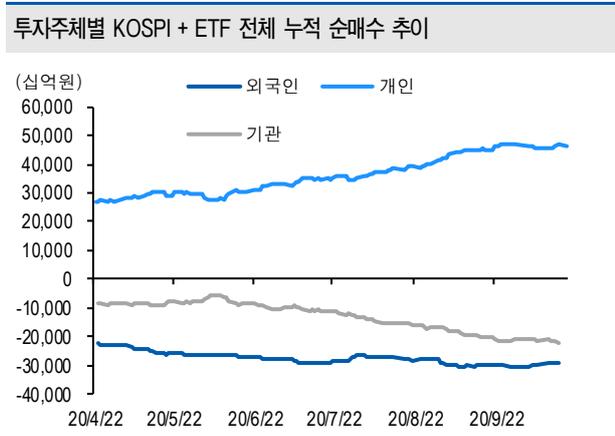


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.28	0.14	-0.14	-0.04%
베이스(mini)	0.13	0.13	-0.13	0.00%
제1스프레드(SP)	-3.46	-4.57	-4.65	-0.35%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	-0.17	-0.17	-0.10%

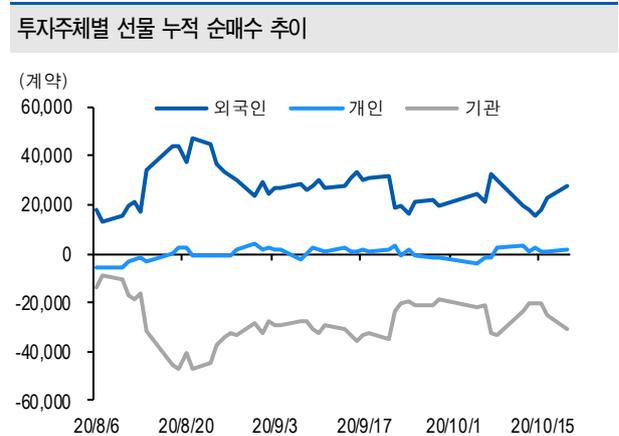


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	41.5	-29.1	12.4	0.0	35.5	41.3	317.9	0.5	1.5	24.0
개인	-348.7	13.5	-335.2	0.0	0.4	79.5	8.2	0.2	-1.0	-40.6
기관	296.0	19.5	315.5	28.5	-174.6	-114.3	-326.0	-0.2	-0.3	16.1
금융투자	451.3	60.7	512.0	0.0	4.1	-317.2	-326.0	-0.2	-0.9	6.4
투신	28.3	-24.0	4.3	0.0	-9.0	226.9	0.0	0.0	0.0	0.6
은행+보험+기타금융	-12.1	19.6	7.6	0.0	-4.9	18.4	0.0	-0.1	0.6	0.3
연기금+국가자재	-162.3	-0.6	-162.8	28.5	-152.7	-42.4	0.0	0.0	0.0	8.7
기타법인	11.2	-4.0	7.2	0.0	0.3	-6.6	-0.1	-0.4	-0.2	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

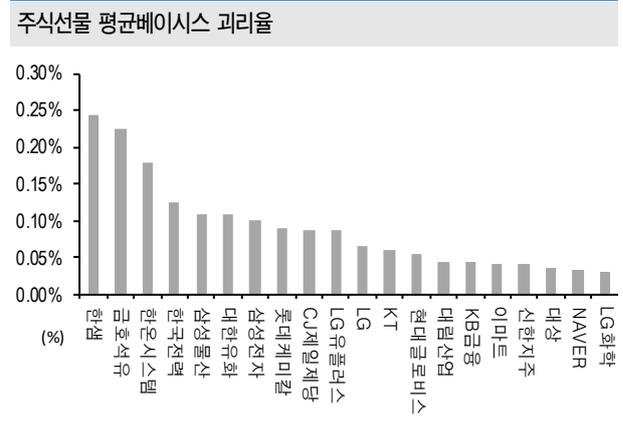
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	552,290	213.9	619,948	18.4%	지수옵션 전체	1,098,775	397.2	1,686,461
Put	546,485	183.3	1,066,513	21.7%	PCR(금액기준)	0.86	VKOSPI	22.51%(+0.48%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	3.15	-0.08	29,736	6,428	111	18.5	Put	315.0(K+1)	7.78	-0.33	2,248	5,253	-93	20.1
	317.5(K+2)	4.09	-0.07	11,727	6,535	201	18.8		312.5(K+0)	6.58	-0.30	7,157	4,360	446	20.5
	315.0(K+1)	5.19	-0.12	8,617	4,564	437	19.1		310.0(K-1)	5.55	-0.30	9,502	6,596	-174	21.0
	312.5(K+0)	6.50	-0.12	3,582	2,186	74	19.6		307.5(K-2)	4.66	-0.28	8,258	5,382	156	21.5
	310.0(K-1)	7.96	-0.09	2,142	4,346	36	20.0		305.0(K-3)	3.90	-0.27	19,438	9,577	205	22.0

자료: KRX, 유안타증권 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	3,924,260	2,696.4	5,434,821	98,707	64,794	-61,248	-6,647	24.0	-40.6	16.1		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,200	0.67	846.4	100.4	1,405,505	-1,712	0.10%	5,155	-8,908	4,706	-8,089	4,272
SK 하이닉스	87,000	1.64	213.6	79.2	236,315	2,943	0.02%	4,193	-23,236	19,000	-507	14,724
한화솔루션	43,250	-2.70	137.0	70.3	67,606	-3,824	-0.04%	5,002	-8,282	3,188	354	2,762
삼성 SDI	413,000	-1.90	82.7	70.2	12,680	54	-0.05%	144	236	-472	251	-175
LG 이노텍	164,500	6.13	20.6	65.1	13,989	3,178	-0.14%	927	-626	-209	-265	-2,410
LG 화학	616,000	-4.05	185.5	63.3	22,918	-3,312	0.03%	92	42	-154	-362	2,579
롯데케미칼	223,000	2.06	25.9	60.1	14,263	-2,068	0.09%	-58	-358	728	-979	180
현대차	167,000	-2.91	214.2	59.8	59,725	-1,625	-0.27%	-2,661	2,201	539	4,923	391
삼성전기	139,500	1.09	29.3	57.7	23,987	-424	-0.17%	1,716	-2,256	644	-372	813
LG 생활건강	1,553,000	-1.15	26.3	57.2	1,373	120	-0.05%	-1	10	-9	14	-115

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터