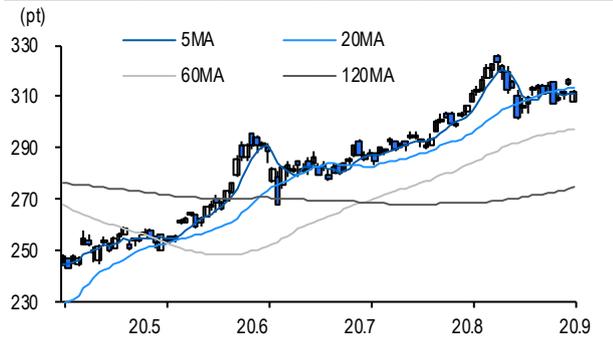


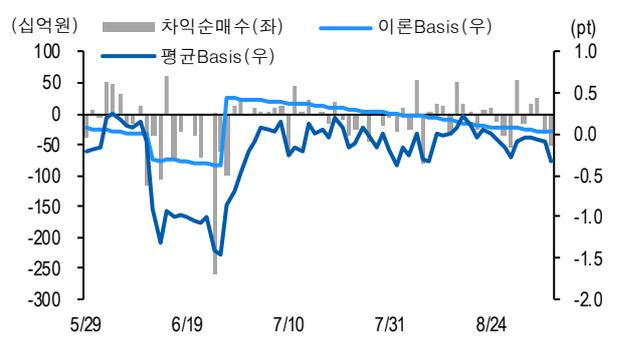


선물옵션시장 지표 2020.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.03	-1.39	-4.40	12,631.3	-
선물 9월물	311.05	-1.54	-4.85	21,541.7	290,276
선물 12월물	310.90	-1.50	-4.75	477.1	49,790
9월물(mini)	311.20	-1.49	-4.60	2,367.4	144,643
10월물(mini)	310.64	-1.58	-4.98	36.5	31,913

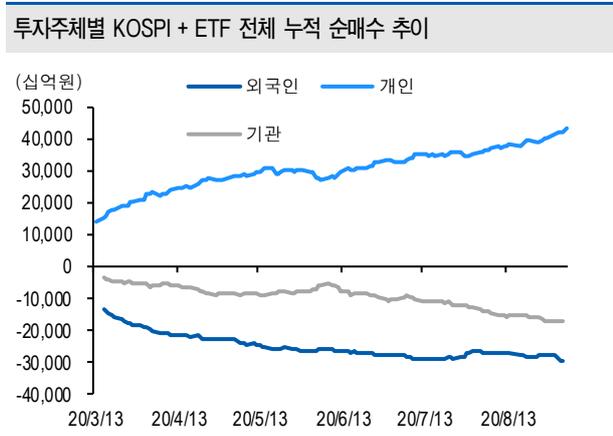


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.03	-0.34	-0.98	-0.12%
베이스스(mini)	0.03	-0.34	-0.83	-0.12%
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.29	-0.30	-0.04%
합성선물 베이스스(ATM)	0.03	-0.92	-0.92	-0.31%

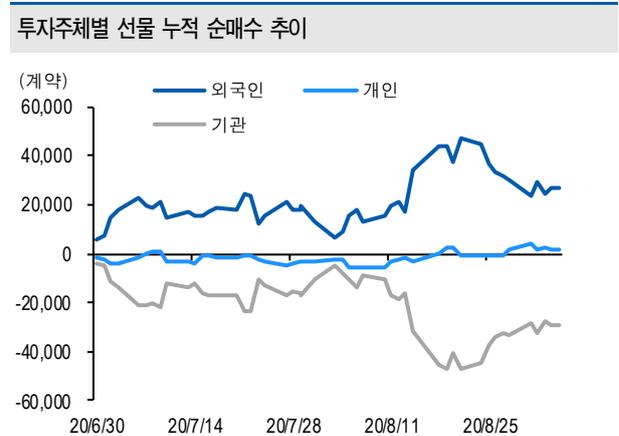


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-467.3	1.4	-465.9	0.0	-351.7	708.2	-422.5	-5.7	0.2	7.6
개인	1,285.4	131.8	1,417.2	0.0	-1.5	-268.8	-6.4	1.6	1.3	-22.7
기관	-779.7	-146.6	-926.2	-50.3	-104.8	-458.4	429.5	3.7	-1.2	14.7
금융투자	-510.9	-203.9	-714.8	-1.6	-21.6	-196.8	429.3	3.8	-1.4	15.1
투신	-56.6	4.3	-52.3	0.0	-35.0	-308.1	0.2	0.0	0.2	-71.5
은행+보험+기타금융	-25.4	45.8	20.5	0.0	-28.8	-3.3	0.0	0.0	0.0	1.1
연기금+국가자재	-105.0	-1.6	-106.6	-48.7	1.2	49.8	0.0	0.0	0.0	70.0
기타법인	-38.4	13.4	-25.1	0.0	-0.2	19.0	-0.5	0.4	-0.2	0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

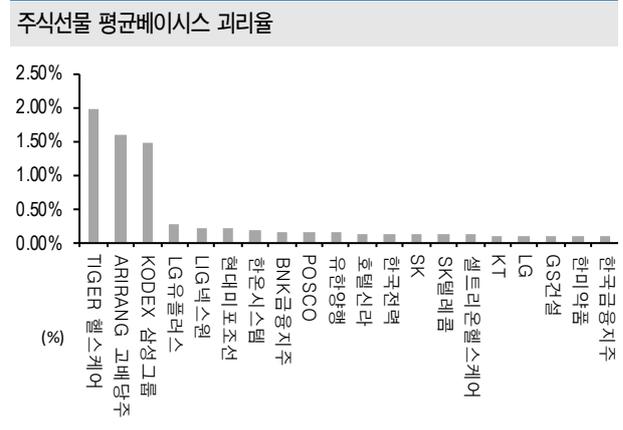
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,296,242	341.8	852,664	20.7%	지수옵션 전체	2,619,541	763.0	2,321,215
Put	1,323,299	421.2	1,468,551	27.6%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	27.83%(+2.53%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.31	-0.61	131,434	34,450	1,140	20.5	Put	320.0(K+1)	9.81	3.53	986	3,493	-112	27.8
	322.5(K+2)	0.56	-0.88	131,465	21,893	-1,563	20.6		317.5(K+0)	7.89	3.10	4,823	4,885	-283	26.9
	320.0(K+1)	0.94	-1.24	189,400	26,657	2,553	20.6		315.0(K-1)	6.23	2.65	8,450	8,167	115	26.7
	317.5(K+0)	1.50	-1.67	160,967	19,089	2,941	20.6		312.5(K-2)	4.84	2.17	20,421	5,598	-354	26.8
	315.0(K-1)	2.34	-2.14	132,427	16,757	16	20.9		310.0(K-3)	3.74	1.77	43,030	12,438	-486	27.4

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	5,448,889	3,757.0	6,301,632	152,790	12,899	48,288	-66,645	7.6	-22.7	14.7		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대림산업	90,800	-1.20	30.9	82.9	29,135	-3,173	0.01%	1,718	-539	-1,276	-524	2,061
신세계	207,000	-3.27	22.5	75.4	4,246	-5,715	-0.05%	1,338	239	-1,607	313	3,115
현대차	172,000	-2.82	353.6	71.9	111,943	-15,725	0.02%	-529	-3,116	3,804	3,338	7,584
SK 하이닉스	78,700	0.00	248.2	71.9	242,386	34,044	0.05%	-252	19,668	-19,982	-3,618	-21,268
기아차	42,100	-1.52	38.0	60.1	56,406	-4,089	-0.01%	864	-2,277	1,413	1,836	-2,502
LG 이노텍	158,000	-3.07	23.8	56.4	26,775	-2,950	-0.32%	-10	143	-138	529	2,669
삼성전자	55,800	-1.24	680.5	55.7	1,259,310	23,088	0.06%	-30,224	42,791	-16,355	-18,013	7,022
LG 전자	82,900	-3.15	44.1	54.2	19,833	-18,589	-0.18%	4,119	-1,187	-2,932	2,629	3,715
삼성전기	135,000	3.85	84.9	52.8	34,310	2,789	-0.05%	5,563	-2,860	-2,699	-11,811	-5,358
LG 화학	740,000	-3.65	288.9	50.9	37,167	-10,322	-0.11%	-236	-5,138	5,376	1,928	6,144

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터