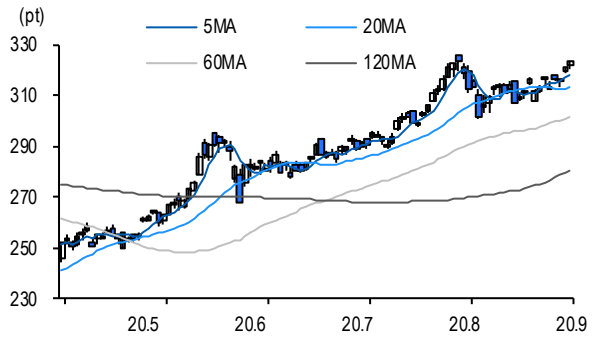
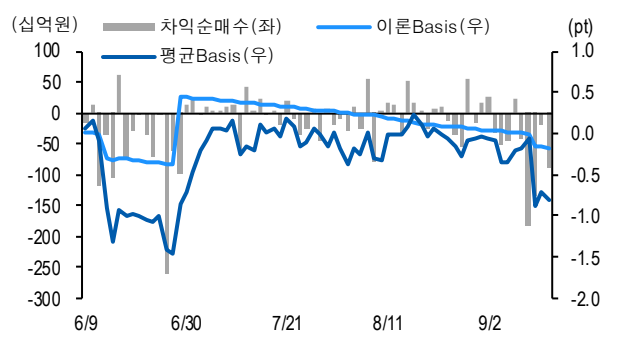


선물옵션시장 지표 2020.9.16

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	323.36	0.74	2.38	7,516.0	-	
선물 12월물	322.15	0.67	2.15	14,463.0	269,960	
선물 3월물	319.55	0.77	2.45	6.2	4,148	
10월물(mini)	322.26	0.66	2.12	1,543.1	71,885	
11월물(mini)	322.06	0.68	2.18	4.7	292	

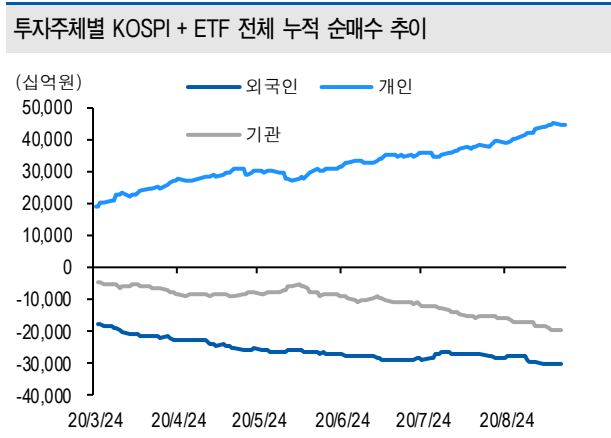


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.17	-0.80	-1.21	-0.19%	
베이스스(mini)	0.13	-0.72	-1.10	-0.26%	
제1스프레드(SP)	-3.44	-3.20	-3.20	0.07%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.13	-1.09	-1.09	-0.38%	

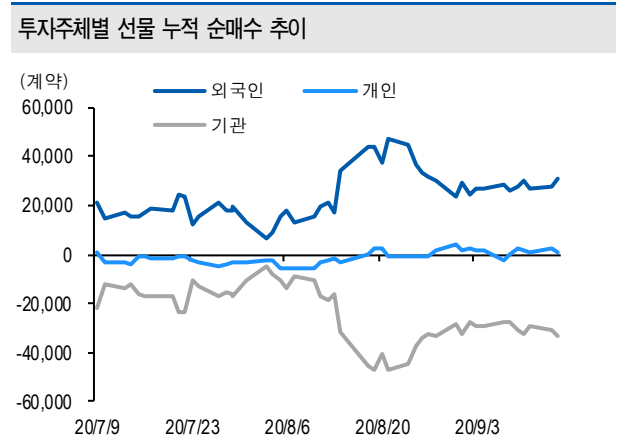


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	253.0	4.2	257.1	0.0	-27.7	324.1	-4.2	3.1	-0.3	-11.9	
개인	-75.8	-11.1	-86.9	0.0	1.3	-115.6	-14.4	0.1	-0.5	14.9	
기관	-200.7	0.2	-200.6	-90.0	-109.9	-202.8	18.3	-3.6	0.7	-6.7	
금융투자	-103.5	108.4	4.9	-107.7	-13.9	-167.1	18.0	-3.7	0.5	-14.7	
투신	-80.9	-23.0	-103.9	0.0	-38.2	49.8	0.4	0.2	0.1	31.4	
은행+보험+기타금융	-20.6	-76.2	-96.8	0.0	-20.3	-62.5	-0.1	0.0	0.0	-0.3	
연기금+국가자재	14.4	-33.1	-18.8	17.7	-12.5	-23.1	0.0	0.0	0.0	-23.2	
기타법인	23.6	6.8	30.4	0.0	0.0	-5.7	0.2	0.4	0.1	3.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

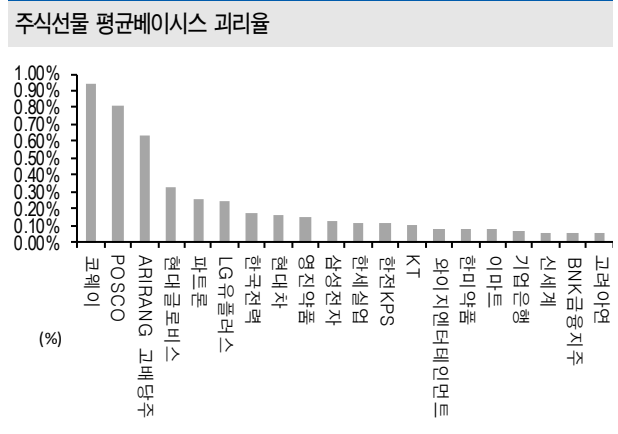
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	440,721	192.0	562,708	16.7%	지수옵션 전체	885,993	336.3	1,465,633
Put	445,272	144.2	902,925	20.1%	PCR(금액기준)	0.75	VKOSPI	20.97%(-0.31%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	3.52	0.58	35,292	10,625	1,154	16.7	Put	322.5(K+1)	6.00	-1.32	2,829	935	633	18.7
	325.0(K+2)	4.60	0.70	33,130	14,689	516	16.9		320.0(K+0)	4.92	-1.16	8,133	3,901	1,522	19.0
	322.5(K+1)	5.75	0.85	8,304	5,708	67	16.9		317.5(K-1)	4.03	-0.99	6,948	2,069	511	19.4
	320.0(K+0)	7.19	1.05	4,579	5,617	-59	17.2		315.0(K-2)	3.27	-0.86	18,894	7,018	676	19.8
	317.5(K-1)	8.79	1.19	1,122	5,229	-214	17.5		312.5(K-3)	2.66	-0.72	19,513	4,460	541	20.3

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	3,512,783	2,873.4	5,644,139	83,817	-23,788	24,419	-2,400	-11.9	14.9	-6.7		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	91,700	-0.54	65.8	75.0	27,991	-7,205	-0.13%	1,674	329	-1,937	1,067	754
삼성 SDI	453,000	3.90	135.5	74.0	18,153	1,351	0.03%	233	149	-704	-147	-1,566
현대차	179,500	-0.55	347.6	72.7	125,607	5,948	0.17%	-2,071	3,763	-1,708	-310	-2,258
LG 이노텍	169,000	-0.59	20.2	68.5	21,087	335	-0.02%	-606	-172	776	265	-861
NAVER	312,000	2.80	167.5	67.8	44,538	2,096	0.00%	870	19	-948	-2,122	-461
기아차	44,700	0.90	65.8	67.7	51,117	13,554	0.01%	-6,549	-116	6,731	5,794	-11,334
카카오	381,000	1.87	198.5	61.1	45,566	-1,795	-0.18%	2,472	-560	-2,015	-1,299	-1,428
삼성전자	60,700	0.83	649.3	59.9	1,627,796	-11,472	0.12%	-3,948	-26,466	30,925	2,596	21,476
호텔신라	75,500	0.67	24.6	55.2	60,276	-610	0.04%	3,446	-1,103	-2,268	-2,383	491
LG 화학	726,000	1.97	159.0	50.9	36,928	1,270	-0.27%	-772	1,244	-496	81	-365

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터