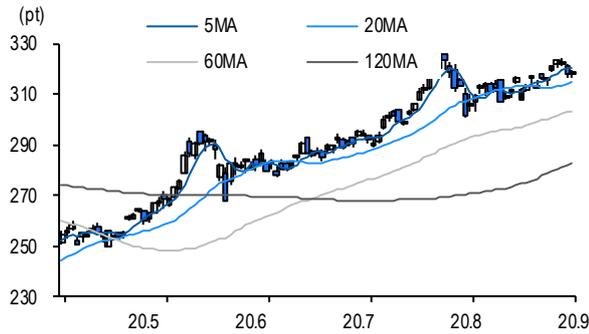


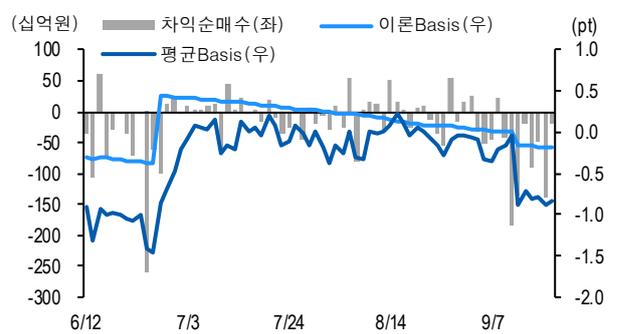


선물옵션시장 지표 2020.9.21

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	318.39	0.12	0.39	8,271.8	-	
선물 12월물	318.45	0.54	1.70	18,037.4	267,763	
선물 3월물	314.55	0.30	0.95	10.2	4,170	
10월물(mini)	318.52	0.50	1.58	2,059.2	71,313	
11월물(mini)	318.18	0.51	1.60	7.0	480	

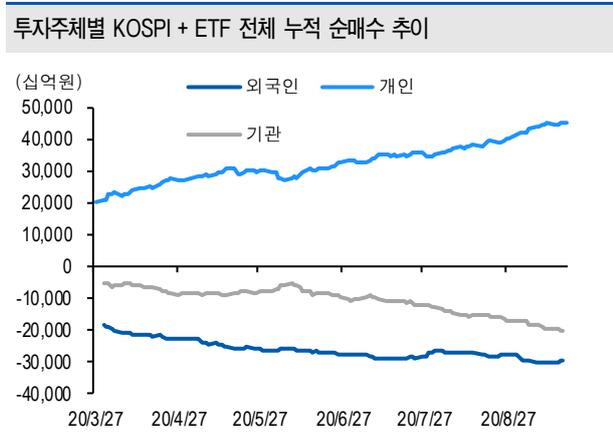


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.19	-0.84	0.06	-0.20%	
베이스스(mini)	0.11	-0.69	0.13	-0.25%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.11	-3.10	0.11%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	0.11	0.11	0.00%	

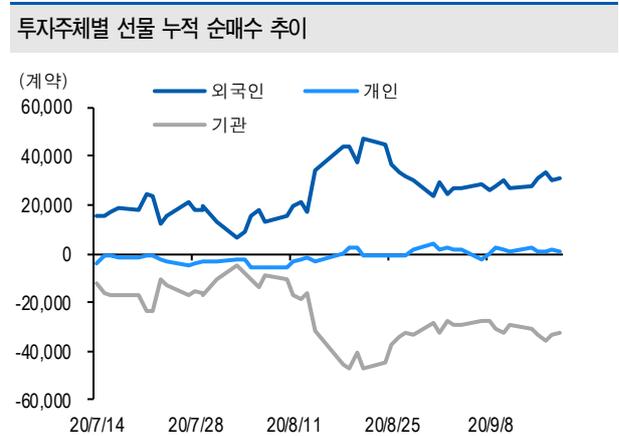


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	144.4	12.9	157.3	0.0	-1.7	-35.4	70.7	1.5	2.6	17.9	
개인	-141.0	-84.5	-225.5	0.0	-0.7	-94.3	0.4	-1.2	0.1	6.4	
기관	-16.4	70.0	53.6	-18.9	-70.8	131.9	-70.7	-0.2	-2.4	-25.4	
금융투자	76.0	106.3	182.3	-33.3	-5.5	-108.9	-70.1	-0.2	-2.5	32.7	
투신	-28.3	-18.2	-46.5	0.0	-20.5	241.3	-0.6	0.0	0.1	-7.2	
은행+보험+기타금융	-18.6	-10.5	-29.1	-3.2	-3.1	13.9	0.0	0.0	0.0	-3.0	
연기금+국가지자체	-9.1	-12.2	-21.3	17.6	-23.9	-14.4	0.0	0.0	0.0	-47.9	
기타법인	13.0	1.6	14.6	0.0	-4.2	-2.1	-0.4	-0.2	-0.3	1.1	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	658,365	224.0	633,386	17.7%	지수옵션 전체	1,352,257	476.2	1,666,559
Put	693,892	252.1	1,033,173	18.6%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	21.59%(-0.72%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	2.59	0.13	67,876	15,045	1,582	17.7	Put	320.0(K+1)	6.12	-1.29	3,738	4,733	-61	16.3
	322.5(K+2)	3.50	0.19	35,338	7,798	-794	18.0		317.5(K+0)	4.97	-1.16	6,883	4,052	987	16.9
	320.0(K+1)	4.59	0.27	17,209	6,994	256	18.3		315.0(K-1)	4.00	-1.09	13,518	9,643	813	17.5
	317.5(K+0)	5.97	0.42	5,407	5,981	637	19.0		312.5(K-2)	3.21	-0.95	30,870	5,676	433	18.2
	315.0(K-1)	7.47	0.51	1,707	4,998	143	19.6		310.0(K-3)	2.58	-0.85	45,950	15,845	441	18.9

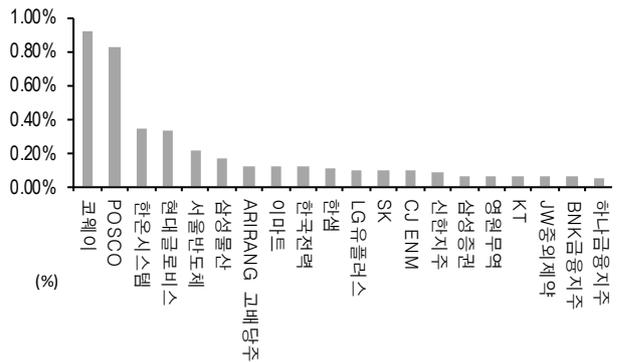
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,195,456	3,516.2	5,780,692	79,709	15,580	15,772	-32,609	17.9	6.4	-25.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	90,000	-0.66	73.8	89.7	24,737	-1,165	-0.06%	-2,017	1,143	2,341	1,210	1,321
삼성전자	59,000	-0.17	968.3	87.5	1,524,378	5,328	0.00%	15,827	7,385	-23,259	19,320	-40,138
현대차	181,500	-1.09	391.2	84.0	126,314	-2,496	0.04%	-1,575	77	1,612	3,319	1,016
삼성 SDI	453,000	1.68	140.5	79.1	19,133	-1,525	-0.08%	30	-335	327	-486	1,287
기아차	48,050	-0.52	83.7	77.3	74,842	15,321	0.01%	-5,096	-3,053	8,130	3,385	-4,933
호텔신라	75,700	-0.66	25.5	65.2	56,608	-3,105	0.01%	-4,396	-1,035	5,423	1,049	4,548
카카오	371,500	0.54	112.9	61.8	43,489	-747	-0.17%	665	-1,080	416	325	-325
SK 하이닉스	83,500	2.08	263.9	61.3	252,199	35,793	0.03%	-245	12,359	-13,307	-721	-32,031
LG 화학	664,000	2.63	640.3	56.2	38,088	-1,607	-0.09%	1,872	-1,055	-1,102	-202	-722
삼성전기	142,000	2.53	32.1	51.9	50,077	1,381	0.04%	557	1,828	-2,342	-818	-1,398

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터