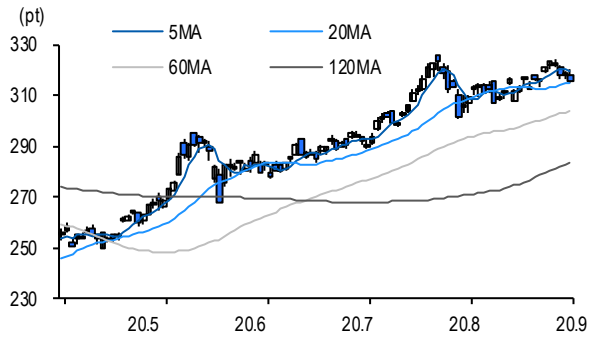


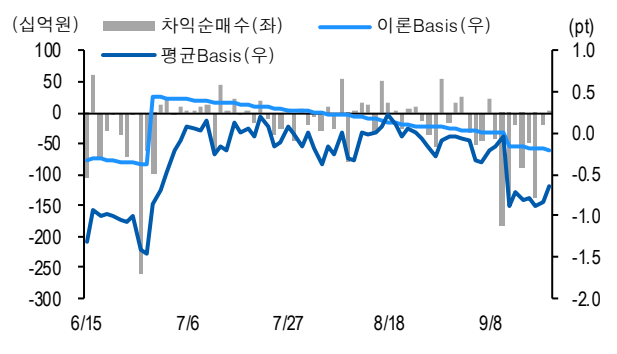


선물옵션시장 지표 2020.9.22

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.89	-0.79	-2.50	8,133.4	-
선물 12월물	315.45	-0.94	-3.00	21,151.6	271,560
선물 3월물	312.10	-0.78	-2.45	19.5	4,148
10월물(mini)	315.50	-0.95	-3.02	2,330.5	83,490
11월물(mini)	315.50	-0.84	-2.68	16.8	478

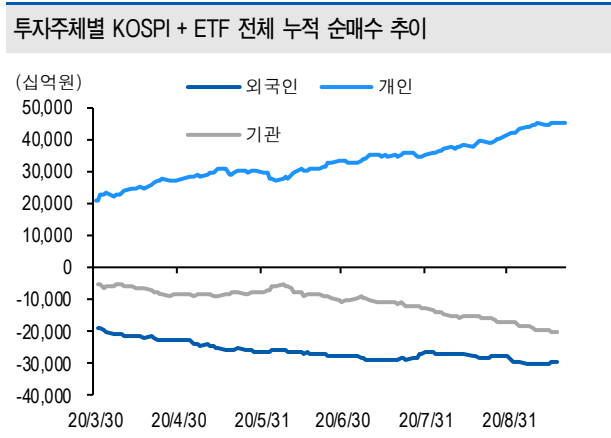


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-0.21	-0.65	-0.44	-0.14%	
베이스(mini)	0.09	-0.59	-0.39	-0.22%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.20	-3.20	0.08%	
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.36	-0.36	-0.14%	

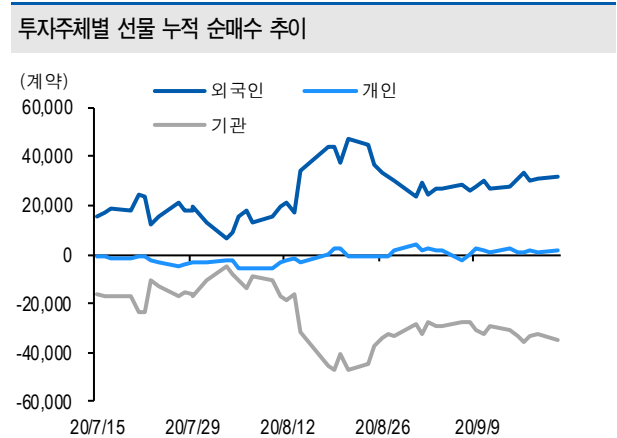


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-77.8	-32.3	-110.1	0.0	-75.6	-61.4	165.3	-2.9	1.9	23.4	
개인	47.1	81.1	128.2	0.0	-0.1	85.7	2.8	1.9	-1.4	-46.3	
기관	32.7	-49.5	-16.8	3.7	-25.8	-9.5	-168.2	1.4	-0.3	23.5	
금융투자	108.9	-66.0	42.9	-3.2	2.8	148.4	-167.4	1.4	-0.8	20.9	
투신	-23.4	0.5	-22.9	0.0	-15.0	-138.5	-0.7	0.1	0.0	-27.2	
은행+보험+기타금융	0.0	24.1	24.2	0.3	-7.7	-9.9	0.0	0.0	0.5	-1.2	
연기금+국가자재	-27.3	-10.3	-37.7	6.6	-7.3	-9.5	-0.1	0.0	0.0	31.0	
기타법인	-2.0	0.7	-1.3	0.0	-2.4	-14.9	0.1	-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	701,180	229.3	648,393	18.6%	지수옵션 전체	1,449,694	486.1	1,727,496
Put	748,514	256.7	1,079,103	20.4%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	23.31%(+1.72%p)

	Call				Put			
	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성
Call	325.0(K+3)	1.80	-0.79	18.6	320.0(K+1)	7.83	1.71	18.4
	322.5(K+2)	2.47	-1.03	18.8	317.5(K+0)	6.44	1.47	18.9
	320.0(K+1)	3.36	-1.23	19.1	315.0(K-1)	5.26	1.26	19.5
	317.5(K+0)	4.47	-1.50	19.6	312.5(K-2)	4.26	1.05	20.0
	315.0(K-1)	5.76	-1.71	20.0	310.0(K-3)	3.45	0.87	20.7

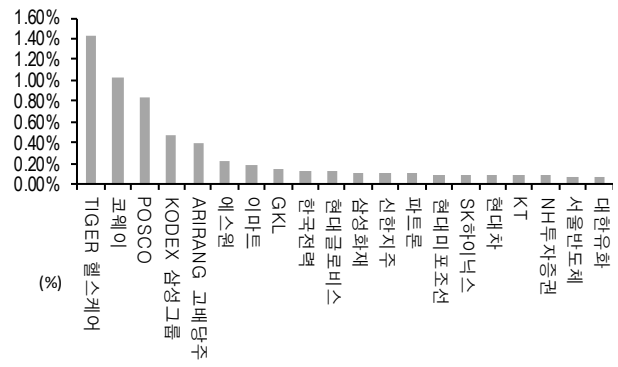
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,867,560	3,782.8	5,842,322	61,630	67,714	-65,469	-2,303	23.4	-46.3	23.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	59,000	0.00	948.5	106.4	1,504,153	-20,225	0.05%	19,224	-18,715	1,830	-2,532	16,568
삼성 SDI	446,500	-1.43	169.4	88.7	17,286	-1,847	-0.05%	106	-931	829	-10	1,593
LG 전자	90,700	0.78	84.6	88.6	17,434	-7,303	-0.14%	-1,468	-2,349	2,335	216	2,423
LG 이노텍	156,500	-3.10	22.7	86.4	13,453	-1,396	-0.66%	303	748	-1,059	862	826
대림산업	82,100	-2.03	15.1	82.9	22,429	-3,574	-0.08%	2,200	-1,267	-944	272	2,009
기아차	48,400	0.73	119.0	80.3	72,471	-2,371	-0.04%	-3,997	-3,351	7,360	6,715	1,157
현대모비스	242,500	1.04	81.9	79.5	21,836	4,036	0.05%	-3,096	-292	3,482	204	-1,527
SK 하이닉스	84,500	1.20	264.9	76.5	246,003	-6,196	0.10%	34	-18,180	18,635	-7,002	14,069
현대차	186,000	2.48	412.1	71.4	125,157	-1,157	0.09%	3,943	-3,008	-1,298	506	-2,326
삼성전기	137,500	-3.17	40.5	65.1	43,094	-6,983	-0.08%	-1,488	926	574	-476	6,024

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터