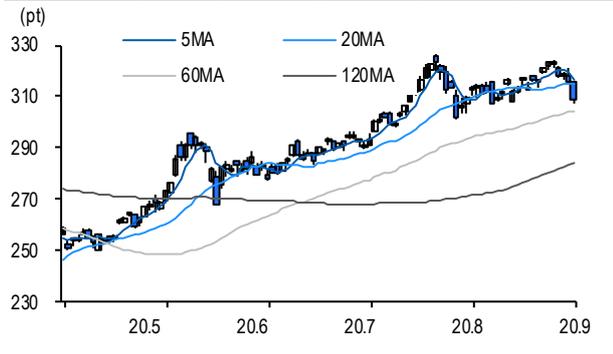
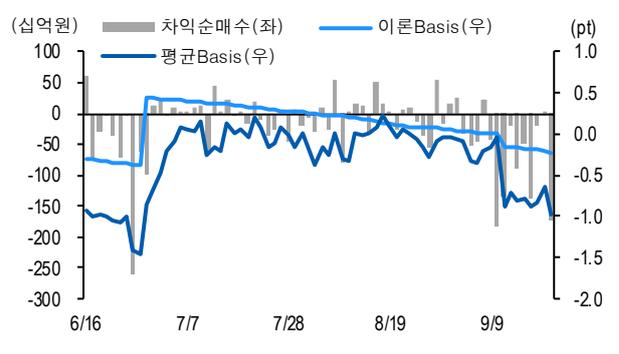


선물옵션시장 지표 2020.9.23

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
OSPI200	308.82	-2.24	-7.07	9,911.3	-
선물 12월물	307.45	-2.54	-8.00	26,501.9	280,650
선물 3월물	304.35	-2.48	-7.75	12.0	4,147
10월물(mini)	307.80	-2.44	-7.70	2,888.9	78,130
11월물(mini)	307.38	-2.57	-8.12	11.9	604

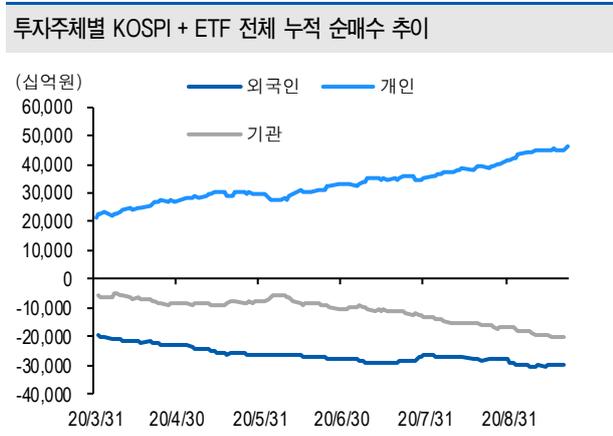


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.23	-0.99	-1.37	-0.25%	
베이스스(mini)	0.09	-0.82	-1.02	-0.29%	
제1스프레드(SP)	-3.46	-3.15	-3.15	0.10%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.09	-1.14	-1.14	-0.40%	

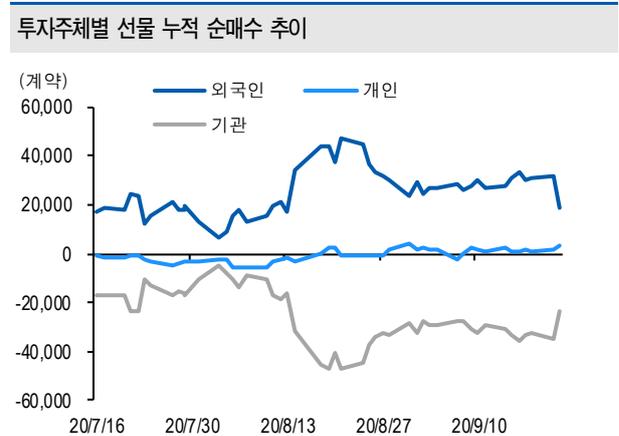


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-14.3	-77.7	-92.0	-21.1	-226.6	-785.6	-249.3	-5.4	8.4	-21.7
개인	991.3	69.5	1,060.7	0.0	-1.0	129.0	22.5	2.6	-0.6	-74.3
기관	-769.1	8.7	-760.4	-152.8	-135.1	646.6	226.7	3.2	-8.0	102.8
금융투자	-489.8	-284.6	-774.5	-82.3	-55.2	749.1	226.4	3.9	-8.1	83.5
투신	-40.1	203.9	163.8	0.0	-16.6	-187.5	0.2	-0.7	0.0	-65.6
은행+보험+기타금융	-14.7	74.3	59.6	0.0	-8.3	5.2	0.1	0.0	0.0	2.4
연기금+국가지자체	-172.0	-8.1	-180.1	-70.5	-35.4	79.8	0.0	0.0	0.0	82.6
기타법인	-207.9	-0.4	-208.3	0.0	0.0	9.9	0.0	-0.4	0.2	-6.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

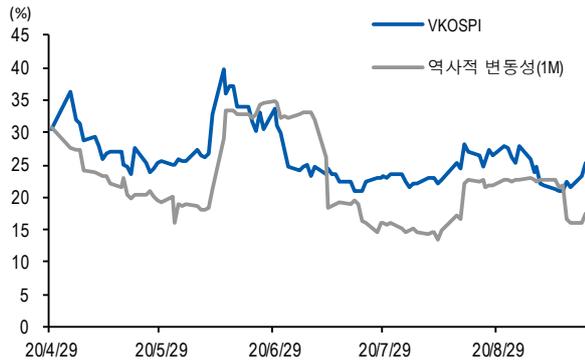
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,127,513	282.2	707,794	19.2%	지수옵션 전체	2,368,451	780.9	1,814,488
Put	1,240,938	498.8	1,106,694	22.8%	PCR(금액기준)	1.77	VKOSPI	25.20%(+1.89%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	0.92	-1.55	108,295	17,303	9,541	19.2	Put	317.5(K+1)	11.65	5.21	3,964	3,205	-856	22.0
	320.0(K+2)	1.30	-2.06	112,632	15,112	6,892	19.2		315.0(K+0)	9.88	4.62	10,299	10,102	-1,583	22.1
	317.5(K+1)	1.84	-2.63	62,701	8,582	1,945	19.3		312.5(K-1)	8.27	4.01	7,729	6,052	51	22.1
	315.0(K+0)	2.56	-3.20	43,740	8,278	3,130	19.6		310.0(K-2)	6.87	3.42	28,382	16,037	-1,259	22.4
	312.5(K-1)	3.48	-3.79	16,342	4,799	2,975	20.0		307.5(K-3)	5.66	2.89	38,565	6,979	-790	22.8

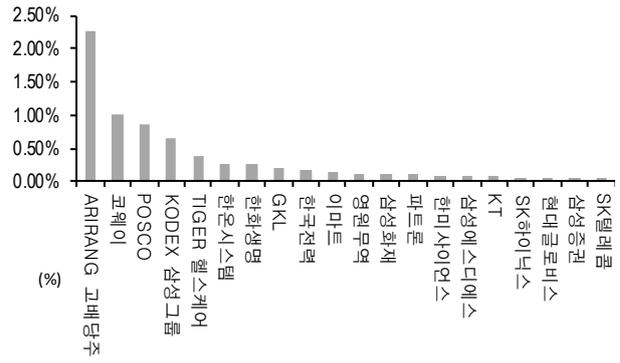
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,595,551	4,694.2	5,803,382	-38,940	-62,936	-56,455	125,080	-21.7	-74.3	102.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	57,800	-2.03	1,284.5	105.2	1,413,208	-90,945	-0.01%	-31,263	-45,389	82,565	55,781	45,392
삼성 SDI	445,000	-0.34	197.6	99.9	15,504	-1,782	-0.05%	288	-1,010	1,165	465	960
LG 이노텍	154,000	-1.60	24.2	98.2	13,048	-405	-0.45%	-98	-37	141	137	-235
SK 하이닉스	81,100	-4.02	302.1	88.8	243,851	-2,152	0.06%	-5,792	-7,398	13,167	3,965	4,813
LG 디스플레이	15,600	-4.00	32.5	82.2	319,964	9,417	-0.66%	-119	-2,947	2,577	3,142	1,603
현대차	179,000	-3.76	442.7	80.7	101,970	-23,187	-0.06%	-1,178	-9,441	10,886	16,632	8,704
호텔신라	75,600	-2.33	34.7	78.2	58,317	-570	0.00%	-3,203	2,010	828	-65	1,287
한국금융지주	71,700	-5.28	46.5	76.3	31,692	-14,515	-0.07%	2,555	-563	-1,956	4,788	6,062
기아차	46,400	-4.13	88.2	75.2	72,569	98	0.00%	4,659	7,577	-12,155	-3,854	-6,203
LG 화학	638,000	1.27	559.4	71.7	37,530	687	0.01%	-151	-1,352	1,637	562	255

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

