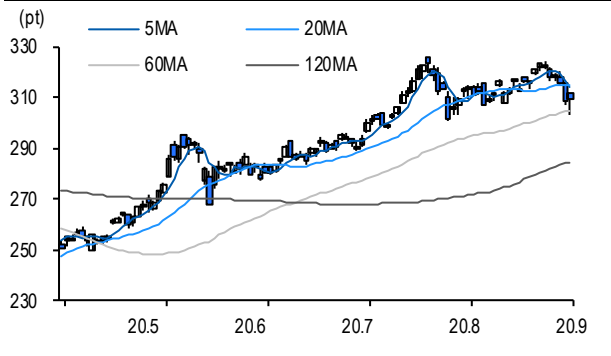
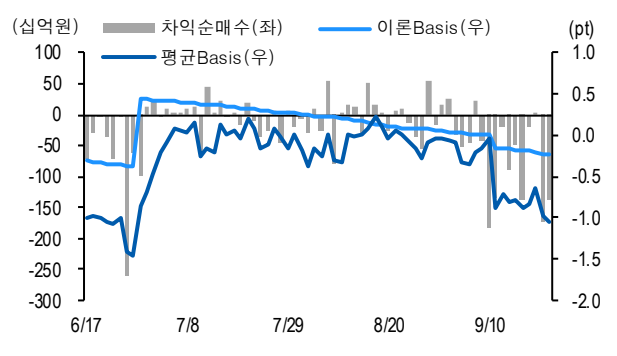


선물옵션시장 지표 2020.9.24

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	309.64	0.27	0.82	8,894.2	-	
선물 12월물	309.30	0.60	1.85	31,520.0	281,766	
선물 3월물	305.65	0.43	1.30	17.4	4,119	
10월물(mini)	309.40	0.52	1.60	3,509.6	85,734	
11월물(mini)	309.04	0.54	1.66	25.2	927	

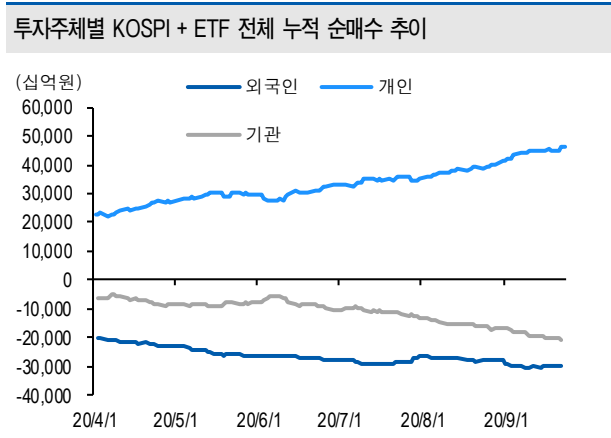


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.23	-1.06	-0.34	-0.27%	
베이스스(mini)	0.08	-0.93	-0.24	-0.33%	
제1스프레드(SP)	-3.46	-3.15	-3.15	0.10%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	-0.26	-0.26	-0.11%	

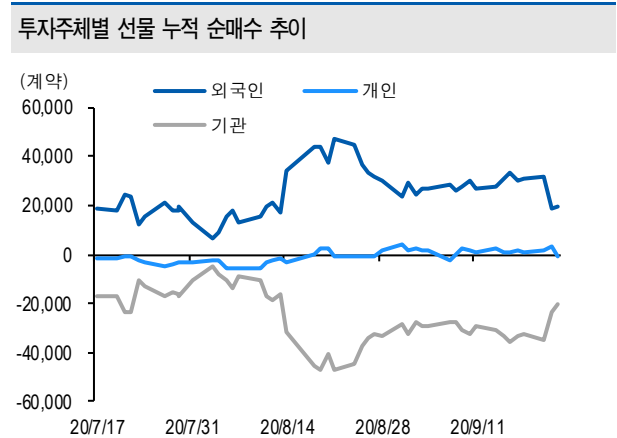


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-58.1	-11.7	-69.9	-73.6	-93.8	128.7	-57.0	1.4	-0.3	-20.0	
개인	326.9	-25.0	301.8	0.0	-1.7	-319.1	-25.5	-3.0	3.0	-68.1	
기관	-280.6	30.2	-250.5	-66.1	-43.6	181.9	81.2	1.9	-2.9	85.8	
금융투자	-260.1	-61.5	-321.6	-69.3	-23.9	-133.6	80.0	4.0	-4.6	124.9	
투신	-13.0	26.5	13.5	0.0	-18.2	290.7	1.1	-0.4	0.1	20.3	
은행+보험+기타금융	13.4	55.1	68.5	0.0	16.3	24.2	0.0	-1.6	1.7	1.2	
연기금+국가자재	-13.2	4.9	-8.3	3.2	-7.2	0.6	0.0	0.0	0.0	-60.5	
기타법인	11.9	6.6	18.5	0.0	0.3	8.6	1.3	-0.2	0.2	2.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

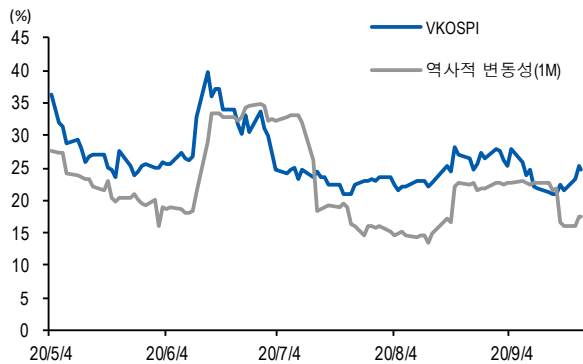
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,284,193	392.4	742,293	19.6%	지수옵션 전체	2,660,526	912.2	1,902,102
Put	1,376,333	519.8	1,159,809	21.8%	PCR(금액기준)	1.32	VKOSPI	24.64%(-0.56%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	1.95	0.11	144,027	13,491	4,909	19.5	Put	312.5(K+1)	6.84	-1.43	1,936	6,212	160	19.1
	315.0(K+2)	2.71	0.15	116,055	12,118	3,840	19.7		310.0(K+0)	5.55	-1.32	9,173	16,002	-35	19.6
	312.5(K+1)	3.66	0.18	75,464	6,708	1,909	20.0		307.5(K-1)	4.50	-1.16	11,647	6,738	-241	20.4
	310.0(K+0)	4.93	0.38	66,334	8,295	1,787	20.8		305.0(K-2)	3.63	-1.03	39,799	17,189	546	21.2
	307.5(K-1)	6.43	0.59	14,497	3,008	1,831	21.8		302.5(K-3)	2.93	-0.88	63,425	11,572	-617	22.0

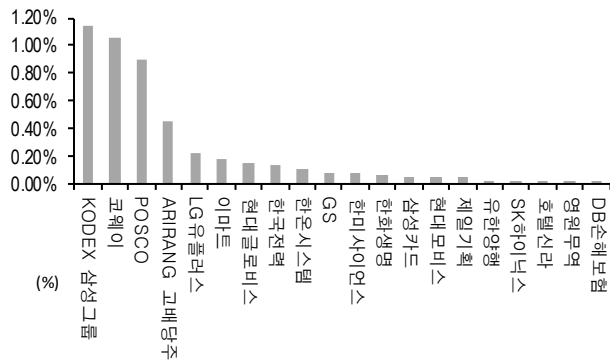
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,698,621	5,492.0	5,772,164	-31,218	-54,174	-120,267	168,608	-20.0	-68.1	85.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	58,300	0.87	1,581.7	135.7	1,360,229	-52,979	-0.01%	-8,374	-74,441	78,822	109,944	-42,496
삼성 SDI	438,500	-1.46	318.1	123.9	16,011	507	-0.03%	-855	-764	1,765	2,598	-1,111
SK 하이닉스	84,100	3.70	396.7	108.4	251,633	7,782	0.03%	-1,998	-20,787	23,107	15,015	-3,626
NAVER	296,500	4.22	301.3	105.1	38,726	8,189	0.01%	-2,354	3,963	-1,666	-936	-3,297
LG 전자	91,200	2.93	105.1	104.7	20,935	3,314	-0.22%	2,060	-1,033	-1,028	2,046	-3,267
호텔신라	75,400	-0.26	32.6	101.7	57,321	-996	0.03%	-1,499	-269	1,768	124	1,646
기아차	46,150	-0.54	105.5	100.0	69,893	-2,676	-0.01%	-2,453	980	1,414	1,693	-1,228
카카오	364,500	3.26	290.4	87.5	42,662	1,603	-0.06%	385	239	-671	2,302	-4,533
LG 이노텍	154,500	0.32	19.6	82.1	13,506	458	-0.44%	630	-99	-529	190	-682
LG 화학	630,000	-1.25	645.5	81.3	36,618	-912	-0.12%	1,390	-185	-1,228	-730	392

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터