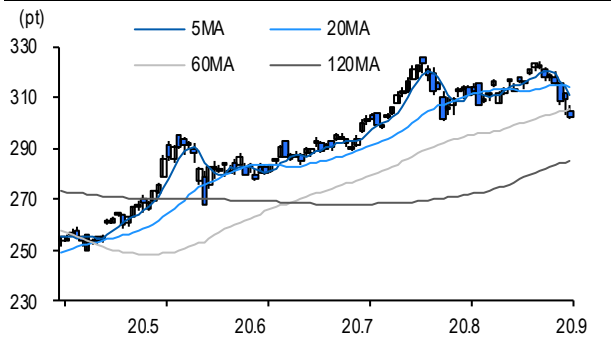


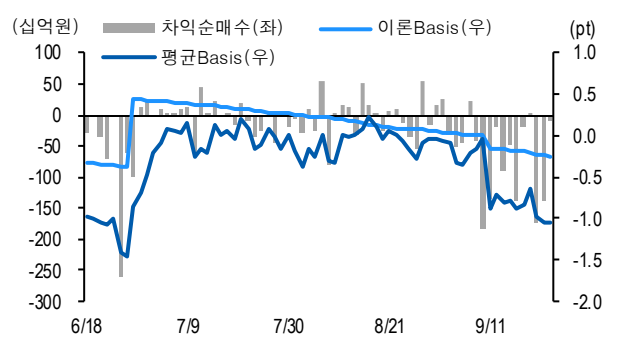


선물옵션시장 지표 2020.9.25

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	302.48	-2.31	-7.16	8,266.0	-
선물 12월물	301.45	-2.54	-7.85	28,481.8	285,302
선물 3월물	298.40	-2.37	-7.25	8.8	4,110
10월물(mini)	301.54	-2.54	-7.86	3,364.7	94,246
11월물(mini)	301.24	-2.52	-7.80	21.1	1,032

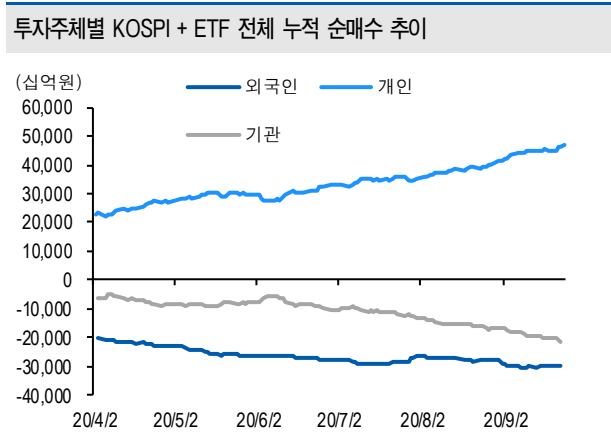


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-0.25	-1.06	-1.03	-0.27%	
베이스(mini)	0.07	-0.96	-0.94	-0.34%	
제1스프레드(SP)	-3.47	-3.20	-3.20	0.09%	
합성선물 베이스(ATM)	0.07	-0.89	-0.89	-0.32%	

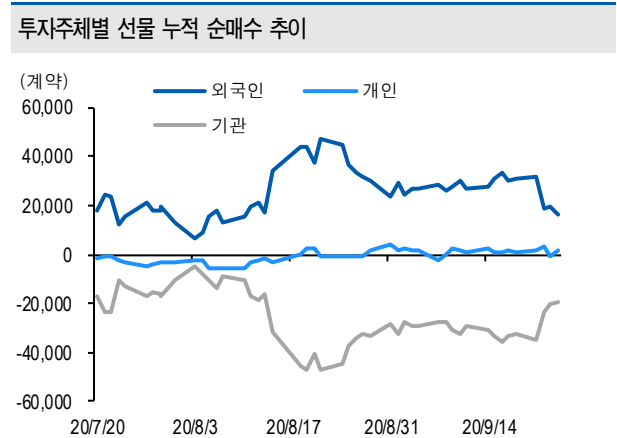


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-195.6	65.9	-129.7	-16.3	-359.6	-251.2	8.4	-2.2	-1.0	-30.8	
개인	353.7	13.3	367.0	0.0	-0.3	169.2	12.6	2.9	4.1	-26.6	
기관	-154.4	-71.0	-225.4	5.8	-59.5	70.1	-21.9	-0.3	-3.5	65.9	
금융투자	-65.9	-20.5	-86.4	-32.1	-37.5	410.7	-21.7	1.8	-4.7	60.6	
투신	-2.5	-95.5	-98.0	0.0	10.1	-322.6	-0.3	-1.5	0.3	-9.7	
은행+보험+기타금융	7.2	22.6	29.8	0.0	5.0	19.1	0.0	-0.7	0.8	0.8	
연기금+국가자자체	-47.6	-4.7	-52.4	37.9	-25.7	-37.2	0.0	0.0	0.0	14.2	
기타법인	-3.7	-8.1	-11.8	0.0	-1.1	12.0	0.9	-0.4	0.4	-8.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,131,974	295.9	782,184	20.6%	지수옵션 전체	2,445,489	825.9	1,978,443
Put	1,313,515	530.0	1,196,259	23.7%	PCR(금액기준)	1.79	VKOSPI	27.21%(+2.57%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	0.69	-1.26	156,740	16,360	2,869	20.4	Put	312.5(K+1)	12.50	5.66	810	6,304	92	23.0
	315.0(K+2)	1.03	-1.68	140,272	20,636	8,518	20.5		310.0(K+0)	10.55	5.00	2,395	15,684	-318	22.7
	312.5(K+1)	1.50	-2.16	94,846	9,496	2,788	20.7		307.5(K-1)	8.81	4.31	2,901	6,306	-432	22.6
	310.0(K+0)	2.14	-2.79	76,948	10,916	2,621	21.1		305.0(K-2)	7.33	3.70	21,374	17,364	175	23.0
	307.5(K-1)	2.95	-3.48	30,195	5,199	2,191	21.4		302.5(K-3)	6.06	3.13	18,373	11,576	4	23.6

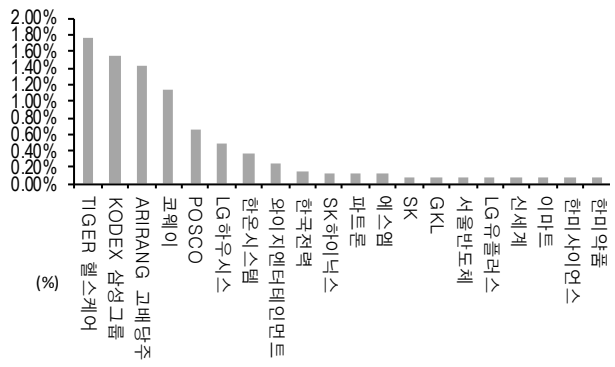
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,690,871	4,265.6	5,858,811	86,647	-48,331	-42,598	100,286	-30.8	-26.6	65.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	57,600	-1.20	1,015.5	100.0	1,365,724	5,495	-0.01%	-48,297	-1,461	53,142	40,628	3,800
기아차	44,650	-3.25	77.7	96.8	76,662	6,769	0.04%	7,605	327	-7,942	-4,645	-6,497
LG 전자	89,300	-2.08	92.4	88.9	31,369	10,434	-0.13%	-751	527	174	1,019	-5,443
SK 하이닉스	84,700	0.71	440.4	81.4	289,592	37,959	0.14%	-7,864	-3,997	12,339	-9,343	-3,867
삼성 SDI	410,000	-6.50	236.8	78.8	15,087	-924	-0.07%	-9	-474	624	-38	908
호텔신라	72,700	-3.58	37.6	77.5	42,132	-15,189	-0.03%	774	877	-1,651	2,564	11,255
LG 화학	614,000	-2.54	396.7	73.2	37,347	729	0.02%	491	-83	-382	1,144	-2,143
한화솔루션	37,100	-0.13	243.8	73.0	42,508	-4,245	-0.13%	-801	-5,409	6,355	5,516	-843
대한유화	153,000	-1.61	9.9	71.9	5,596	1	-0.12%	130	413	24	-62	80
현대차	171,000	-4.74	347.8	71.2	93,227	-9,062	-0.03%	4,459	-2,771	-719	-1,072	5,734

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터