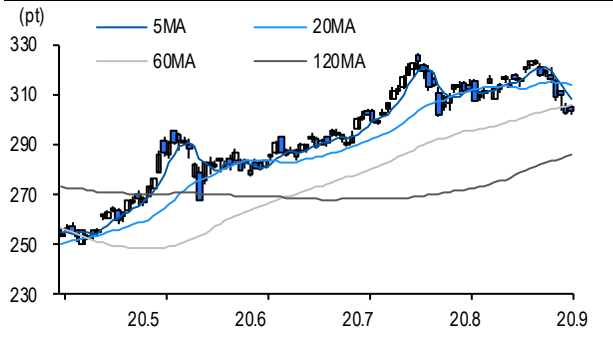


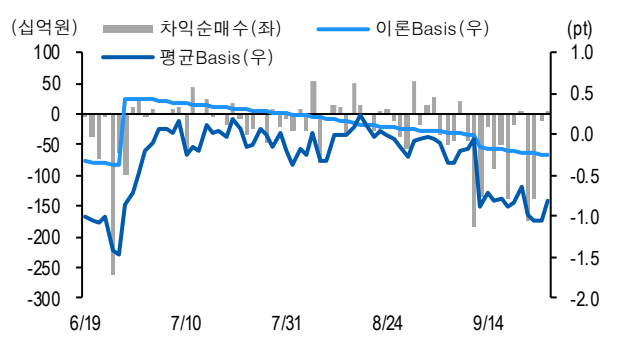


선물옵션시장 지표 2020.9.28

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	303.57	0.36	1.09	6,057.2	-
선물 12월물	303.40	0.65	1.95	20,170.1	282,367
선물 3월물	300.10	0.57	1.70	9.9	4,116
10월물(mini)	303.34	0.60	1.80	2,389.8	94,982
11월물(mini)	302.84	0.53	1.60	10.1	7,583

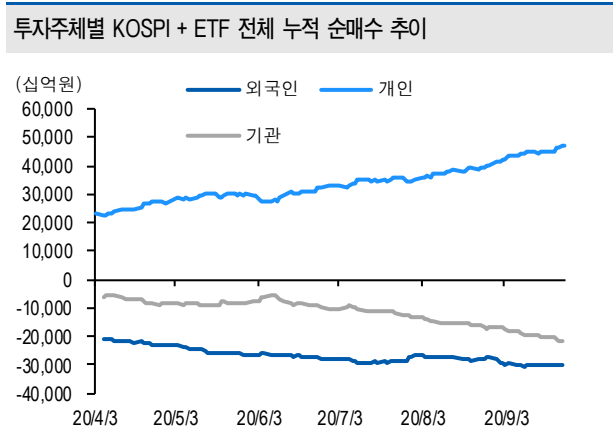


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	-0.25	-0.82	-0.17	-0.19%	
베이스스(mini)	0.07	-0.75	-0.23	-0.27%	
제1스프레드(SP)	-3.47	-3.23	-3.25	0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.07	-0.19	-0.19	-0.09%	

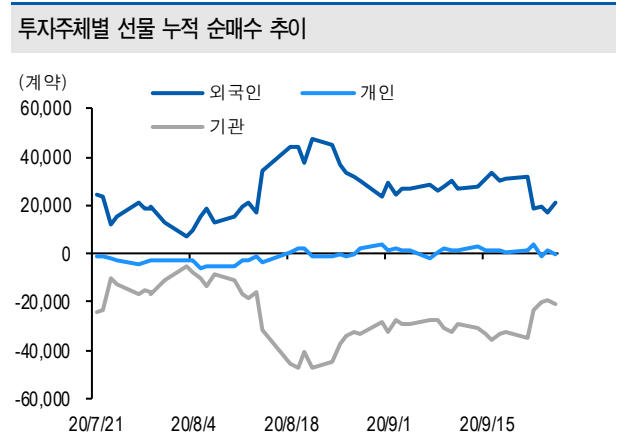


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-90.1	-3.0	-93.1	0.0	-143.1	271.7	54.1	1.3	-2.4	41.0
개인	18.7	-8.3	10.4	0.0	-4.1	-135.0	-12.9	-1.5	3.4	-31.1
기관	72.9	16.1	89.0	6.0	-18.9	-85.0	-40.9	1.5	-0.5	-11.9
금융투자	79.0	9.2	88.3	0.0	0.4	-361.5	-40.7	3.6	-2.6	-7.6
투신	-2.4	30.8	28.4	0.0	-2.6	245.7	-0.2	-0.5	0.1	21.3
은행+보험+기타금융	-6.9	-3.3	-10.2	0.0	-2.5	33.9	0.0	-1.6	2.0	-0.6
연기금+국가자재	7.7	-16.6	-8.9	6.0	-12.8	-3.1	0.0	0.0	0.0	-25.0
기타법인	-1.5	-4.8	-6.3	0.0	0.0	-51.7	-0.2	-1.3	-0.5	1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	785,801	226.3	815,038	20.4%	지수옵션 전체	1,665,107	520.6	2,040,059		
Put	879,306	294.3	1,225,021	22.9%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	26.13%(-1.08%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	2.17	0.03	78,535	15,443	4,527	20.4	Put	305.0(K+1)	5.83	-1.50	6,591	17,846	482	20.1
	307.5(K+2)	3.04	0.09	37,494	6,281	1,082	20.8		302.5(K+0)	4.70	-1.36	13,003	12,010	434	20.9
	305.0(K+1)	4.18	0.22	16,902	5,464	1,076	21.6		300.0(K-1)	3.76	-1.23	35,197	26,106	-61	21.7
	302.5(K+0)	5.58	0.40	7,048	2,917	1,402	22.5		297.5(K-2)	2.98	-1.09	44,914	10,652	219	22.5
	300.0(K-1)	7.15	0.54	1,920	3,905	506	23.5		295.0(K-3)	2.37	-0.94	59,254	20,159	-653	23.4

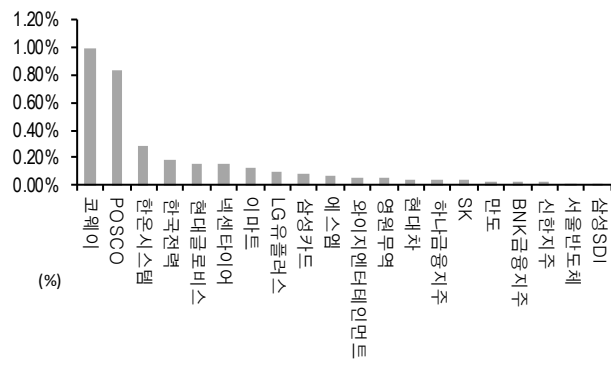
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,159,741	3,060.4	5,864,603	5,792	66,082	-26,751	-44,202	41.0	-31.1	-11.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	82,900	-2.13	292.0	109.1	279,245	-10,347	0.00%	-8,341	2,527	5,812	-461	11,620
대림산업	76,400	1.87	14.8	106.8	19,228	-2,339	-0.06%	2,369	-3,110	741	865	-112
삼성 SDI	411,500	0.37	119.1	98.6	15,683	596	0.01%	1,885	-45	-1,986	-219	-2,010
기아차	44,150	-1.12	75.8	97.6	76,252	-410	0.00%	1,747	-144	-1,613	-1,313	-962
호텔신라	73,000	0.41	19.6	97.5	37,679	-4,453	-0.13%	508	-1,005	507	1,960	1,945
삼성전자	57,700	0.17	541.7	88.3	1,309,909	-55,815	0.01%	34,592	-43,046	6,265	11,337	-7,185
NAVER	295,000	0.51	164.0	87.2	39,495	2,324	0.00%	476	-229	-241	-334	-1,377
LG 화학	625,000	1.79	259.3	85.6	37,896	549	0.00%	994	-561	-183	-1,281	-953
삼성전기	135,500	3.83	63.9	85.3	33,749	-337	-0.26%	1,547	-606	-951	-182	-1,146
카카오	351,000	-0.14	131.6	83.6	40,303	-661	-0.08%	-103	-650	747	393	452

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터