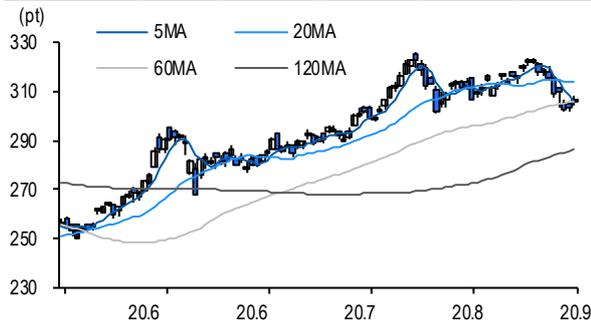


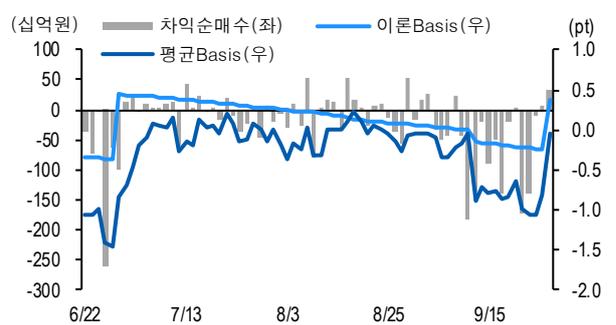


선물옵션시장 지표 2020.9.29

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	307.03	1.14	3.46	5,633.1	-	
선물 12월물	307.65	1.40	4.25	14,330.8	279,765	
선물 3월물	304.25	1.38	4.15	11.2	4,119	
10월물(mini)	307.54	1.38	4.20	1,639.3	100,562	
11월물(mini)	307.32	1.48	4.48	7.4	7,528	

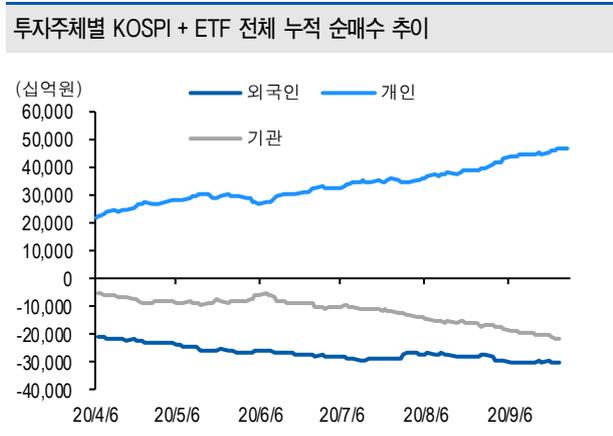


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.39	-0.06	0.62	-0.15%	
베이스(mini)	0.05	-0.09	0.51	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-3.46	-3.21	-3.20	0.08%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.58	0.58	0.17%	

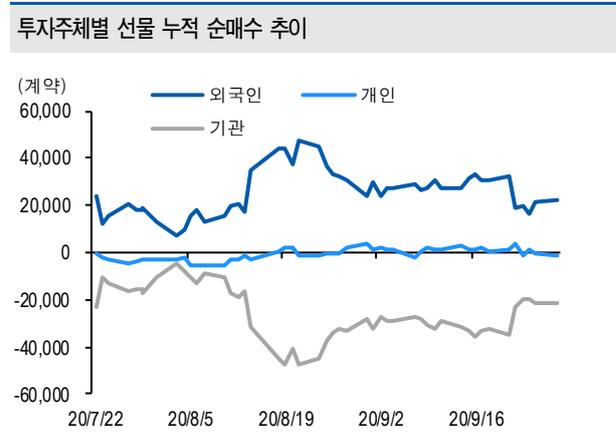


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-63.4	12.8	-50.6	-2.8	-170.7	-111.5	192.1	4.9	2.8	27.7	
개인	-99.3	-36.3	-135.7	0.0	1.4	-85.1	-9.4	-1.9	-5.2	-32.4	
기관	149.9	28.0	177.9	35.2	-75.1	165.8	-183.3	-2.9	2.6	4.6	
금융투자	181.2	16.3	197.6	-3.1	2.5	-205.1	-183.8	-2.7	2.9	32.1	
투신	11.5	4.0	15.5	0.0	4.6	407.3	0.6	-0.2	-0.2	2.9	
은행+보험+기타금융	0.8	18.7	19.6	0.0	7.7	9.1	0.0	0.0	0.0	-0.4	
연기금+국가자재	-44.6	-6.9	-51.5	38.3	-82.0	-45.5	0.0	0.0	0.0	-29.9	
기타법인	12.8	-4.4	8.5	0.0	-0.1	30.7	0.6	0.0	-0.2	0.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	705,654	215.7	816,996	20.1%	지수옵션 전체	1,500,881	408.7	2,062,172
Put	795,227	193.0	1,245,176	22.0%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	25.01%(-1.12%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	3.01	0.84	68,976	16,686	1,243	20.2	Put	305.0(K+1)	3.17	-2.66	19,588	17,737	-109	19.5
	307.5(K+2)	4.27	1.23	25,163	6,893	612	21.0		302.5(K+0)	2.40	-2.30	32,706	10,112	-1,898	20.4
	305.0(K+1)	5.76	1.58	7,241	5,276	-188	21.9		300.0(K-1)	1.81	-1.95	60,550	25,342	-764	21.4
	302.5(K+0)	7.51	1.93	3,717	3,313	396	23.1		297.5(K-2)	1.36	-1.62	45,992	12,489	1,837	22.3
	300.0(K-1)	9.43	2.28	794	3,969	64	24.4		295.0(K-3)	1.01	-1.36	72,177	19,419	-740	23.2

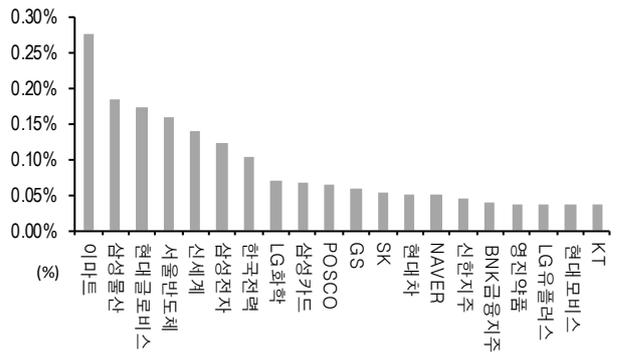
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,239,914	2,775.5	5,977,298	112,695	51,164	-77,953	24,224	27.7	-32.4	4.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	82,500	-0.48	295.0	114.4	196,921	-82,324	-0.07%	13,215	-3,088	-10,983	7,159	32,855
기아차	45,600	3.28	58.9	95.1	87,161	10,909	0.02%	-284	813	-529	4,697	-9,438
삼성 SDI	422,000	2.55	87.3	91.3	15,972	289	0.03%	655	-589	-77	-36	-264
LG 전자	91,900	-1.08	71.3	85.3	45,839	-2,925	-0.01%	-5,998	261	5,653	-1,341	5,893
LG 이노텍	155,000	2.65	13.2	80.3	13,210	-270	-0.16%	213	-58	-155	-195	-173
삼성전자	58,200	0.87	569.9	77.6	1,304,327	-5,582	0.12%	18,774	-25,224	7,506	2,927	-54,698
대림산업	77,400	1.31	7.9	74.3	19,579	351	-0.04%	-193	427	-234	307	-563
NAVER	299,000	1.36	149.2	70.4	41,231	1,736	0.05%	991	808	-1,801	-2,331	169
호텔신라	75,900	3.97	18.8	70.3	39,838	2,159	-0.06%	1,146	707	-1,784	-692	-1,204
한화솔루션	38,100	7.78	164.9	65.1	74,109	14,602	0.01%	4,691	-1,667	-3,406	-3,041	-11,894

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터