

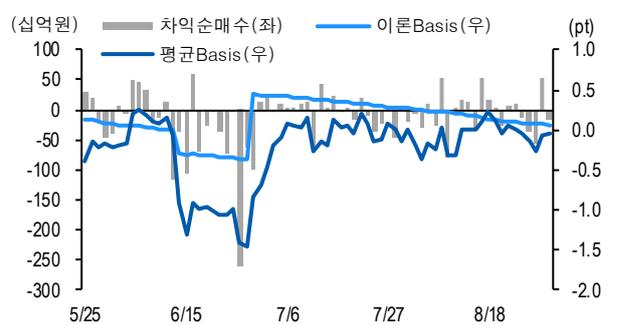


선물옵션시장 지표 2020.9.1

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.14	-1.63	-5.10	13,156.8	-
선물 9월물	306.70	-2.00	-6.25	25,808.1	288,731
선물 12월물	306.35	-2.02	-6.30	201.4	39,776
9월물(mini)	306.50	-2.06	-6.30	3,266.1	104,389
10월물(mini)	306.30	-1.97	-6.14	25.5	26,170

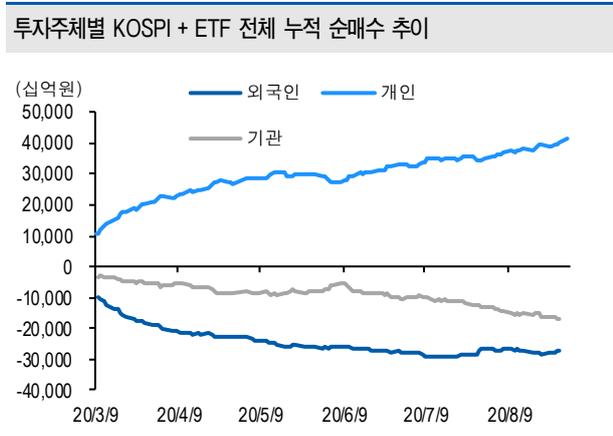


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.05	-0.05	-0.44	-0.03%	
베이스(mini)	0.05	-0.05	-0.64	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.39	-0.40	-0.07%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	-0.38	-0.38	-0.14%	

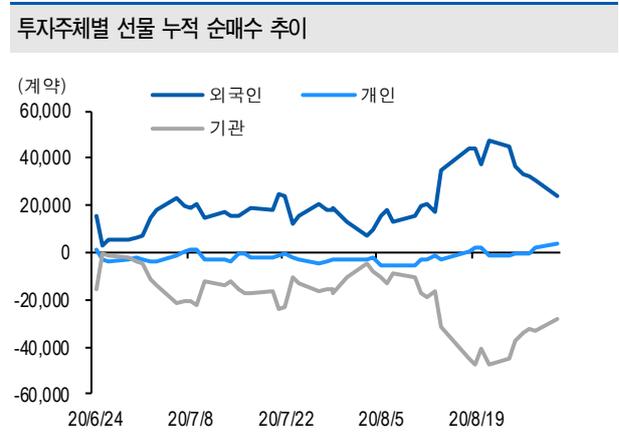


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,631.6	15.9	-1,615.7	0.0	-1,456.2	-427.1	-104.8	-2.1	1.6	48.2
개인	1,576.4	-23.0	1,553.4	0.0	-0.6	129.3	24.0	-0.6	-2.9	-20.5
기관	-6.1	6.9	0.8	-16.7	-57.0	300.6	80.5	2.9	1.7	-28.0
금융투자	96.0	-46.6	49.4	0.1	7.7	632.7	80.9	2.9	1.4	16.8
투신	-54.8	-0.4	-55.2	0.0	-37.0	-360.9	-0.4	0.1	0.1	-5.8
은행+보험+기타금융	-15.5	39.6	24.1	0.0	-7.5	4.0	0.0	-0.1	0.2	0.4
연기금+국가자자체	-23.4	6.3	-17.2	-16.8	-17.9	24.9	0.0	0.0	0.0	-39.4
기타법인	61.3	0.1	61.4	0.0	0.8	-2.8	0.3	-0.2	-0.4	0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





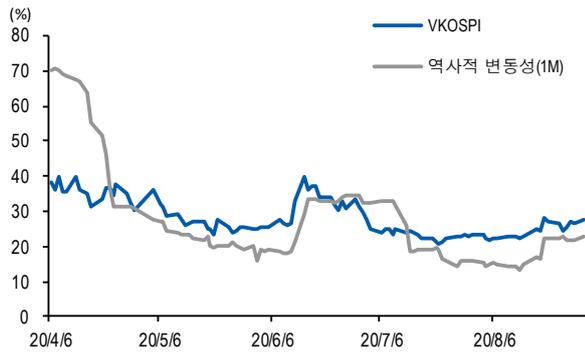
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,224,406	332.1	787,955	23.7%	지수옵션 전체	2,547,035	817.5	2,119,179
Put	1,322,629	485.4	1,331,224	27.2%	PCR(금액기준)	1.46	VKOSPI	27.77%(+1.37%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.10	-1.51	102,422	24,823	5,874	23.8	Put	315.0(K+1)	10.45	3.78	7,870	6,475	-227	26.6
	317.5(K+2)	1.53	-2.03	71,275	13,439	-4,932	23.6		312.5(K+0)	8.65	3.14	17,620	5,010	-1,069	26.1
	315.0(K+1)	2.14	-2.51	52,748	15,465	1,729	23.8		310.0(K-1)	7.13	2.60	29,235	10,500	1,586	26.3
	312.5(K+0)	2.91	-3.07	24,465	8,765	1,226	23.9		307.5(K-2)	5.82	2.10	38,910	7,625	-220	26.6
	310.0(K-1)	3.90	-3.61	7,819	7,324	931	24.2		305.0(K-3)	4.76	1.70	77,149	12,189	1,048	27.3

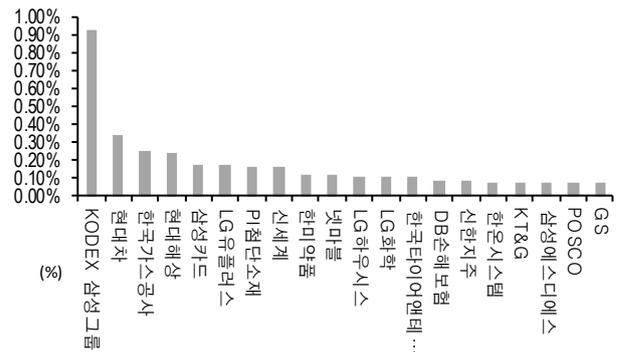
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,106,407	4,072.1	5,540,555	114,349	66,588	-48,053	-16,759	48.2	-20.5	-28.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	747,000	-1.84	386.3	61.9	48,205	579	0.10%	363	224	-501	550	-738
삼성 SDI	452,500	-2.90	162.9	56.9	21,196	798	-0.01%	1,910	-10	-1,856	-188	-1,434
현대차	177,500	2.60	530.0	56.6	141,097	3,201	0.34%	-2,329	-7,466	9,242	3,319	-1,281
대림산업	87,200	-2.35	38.9	55.7	30,536	1,428	0.01%	-1,527	839	614	709	-505
기아차	42,400	-0.82	65.0	54.4	60,934	501	-0.13%	17,345	-102	-17,246	-10,013	-7,748
카카오	405,000	0.12	348.6	52.3	35,516	-1,370	-0.36%	1,299	822	-2,441	-402	1,066
NAVER	323,000	-3.15	259.3	51.9	59,841	37	0.00%	-521	1,439	-881	-776	-228
SK 하이닉스	75,200	-3.22	195.9	50.7	164,252	-3,676	-0.07%	4,070	2,700	-6,657	10,988	-1,257
LG 전자	84,500	-1.17	56.8	48.3	36,733	12,184	-0.06%	237	-569	322	-589	-7,403
삼성전자	54,100	-2.70	797.5	46.0	1,252,401	26,973	0.00%	22,162	-9,875	-11,360	13,152	-28,665

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터