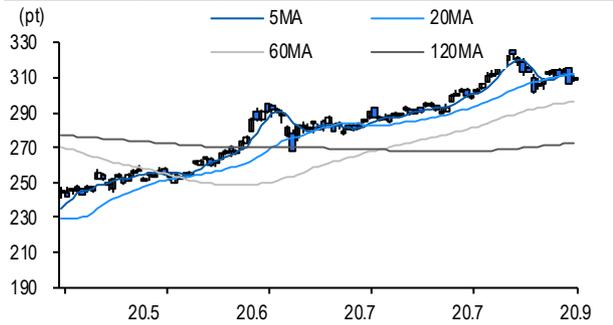


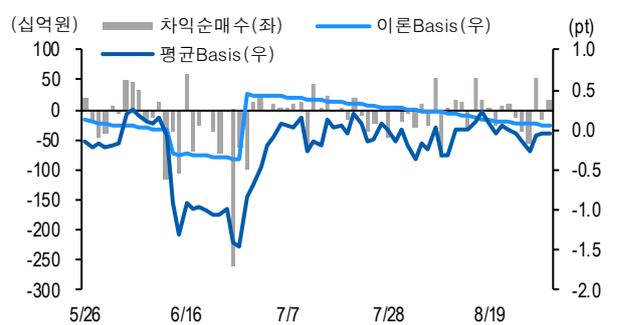


선물옵션시장 지표 2020.9.2

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.81	0.87	2.67	9,709.0	-
선물 9월물	310.45	1.22	3.75	23,065.2	289,121
선물 12월물	309.95	1.18	3.60	177.9	40,820
9월물(mini)	310.50	1.24	4.00	2,358.8	108,379
10월물(mini)	309.62	1.08	3.32	32.6	26,511

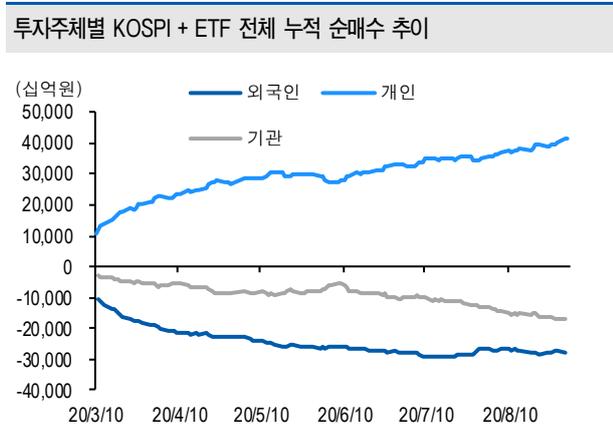


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.05	-0.04	0.64	-0.03%	
베이스스(mini)	0.05	-0.04	0.69	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.40	-0.40	-0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	0.57	0.57	0.17%	

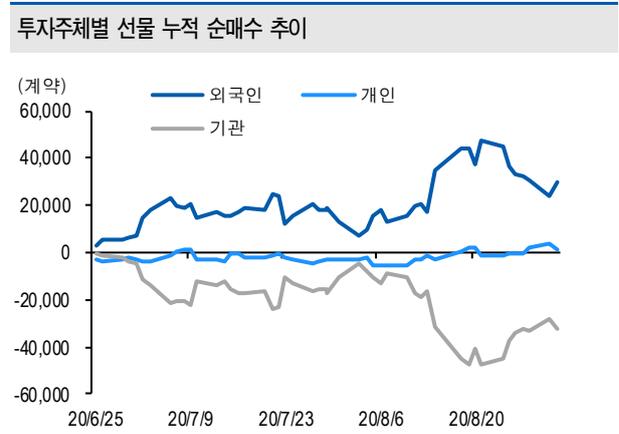


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-207.0	8.4	-198.6	0.0	-198.1	513.1	-30.9	-0.5	-0.2	43.7
개인	239.8	15.7	255.5	0.0	-0.3	-173.4	-21.4	0.0	1.4	4.7
기관	-56.4	-23.4	-79.8	15.7	-106.6	-331.5	53.1	0.7	-1.1	-49.0
금융투자	79.2	-30.8	48.4	-3.1	-6.5	-515.9	52.9	1.0	-1.0	-47.2
투신	-46.4	0.6	-45.8	0.0	-26.9	213.2	0.1	-0.2	0.0	9.4
은행+보험+기타금융	-47.4	24.7	-22.7	0.0	-34.4	-7.7	0.0	-0.1	0.0	-0.4
연기금+국가자자체	-30.6	-8.8	-39.4	18.8	-29.5	-21.1	0.0	0.0	0.0	-10.8
기타법인	23.6	-0.7	22.9	0.0	-0.1	-8.3	-0.8	-0.2	0.0	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,082,053	348.5	813,598	25.0%	지수옵션 전체	2,039,963	656.7	2,178,615
Put	957,910	308.1	1,365,017	27.3%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	27.59%(-0.18%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	2.99	0.85	97,961	20,073	4,608	25.0	Put	310.0(K+1)	4.96	-2.17	9,947	11,022	522	23.9
	312.5(K+2)	4.00	1.09	46,450	9,348	583	25.4		307.5(K+0)	3.98	-1.84	18,834	7,890	265	24.9
	310.0(K+1)	5.37	1.47	21,014	9,067	1,743	26.6		305.0(K-1)	3.18	-1.58	42,858	12,198	9	25.9
	307.5(K+0)	6.86	1.78	4,853	4,648	476	27.5		302.5(K-2)	2.56	-1.35	44,408	8,759	-349	27.1
	305.0(K-1)	8.58	2.05	1,941	5,104	213	28.7		300.0(K-3)	2.07	-1.10	67,990	18,167	619	28.3

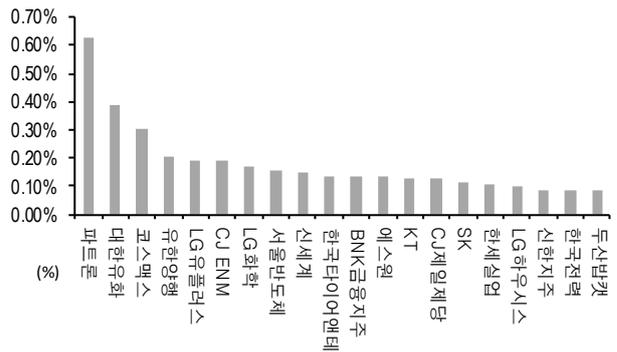
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,595,621	3,278.2	5,645,505	104,950	99,772	22,242	-124,335	43.7	4.7	-49.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	180,500	1.69	390.3	82.9	137,252	-3,845	0.06%	2,551	-39	-2,953	-822	2,406
기아차	43,400	2.36	58.7	81.1	60,598	-336	-0.08%	-1,321	-143	1,485	3,330	-660
LG 이노텍	153,000	5.88	38.1	80.7	29,565	7,455	-0.07%	-198	75	144	-4,955	-828
LG 전자	88,200	4.38	69.8	74.1	50,345	13,612	0.03%	718	-49	-674	-2,260	-7,202
LG 화학	744,000	-0.40	342.3	74.0	50,055	1,850	0.17%	411	72	-618	350	-1,291
현대건설	32,650	0.93	12.4	68.6	22,440	2,195	-0.01%	4,217	1,276	-5,501	-4,919	-4,046
SK 하이닉스	75,300	0.13	118.8	67.4	160,696	-3,556	-0.09%	673	-1,029	299	5,568	7,457
삼성 SDI	455,500	0.66	103.3	65.9	20,649	-547	-0.02%	-184	-214	411	349	288
대림산업	94,300	8.14	47.4	65.8	32,417	1,881	0.01%	2,255	239	-2,379	-4,226	-1,028
삼성전자	54,200	0.18	605.4	63.8	1,255,778	3,377	-0.01%	28,108	-4,707	-22,413	-22,980	16,810

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터