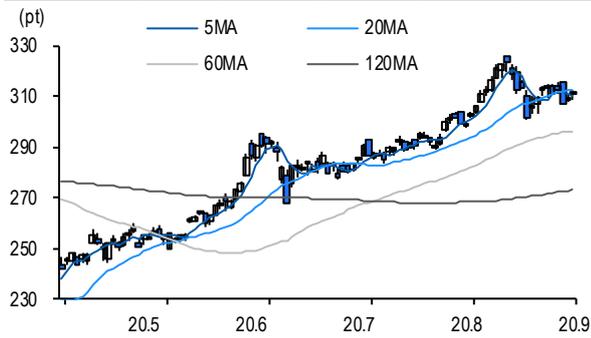


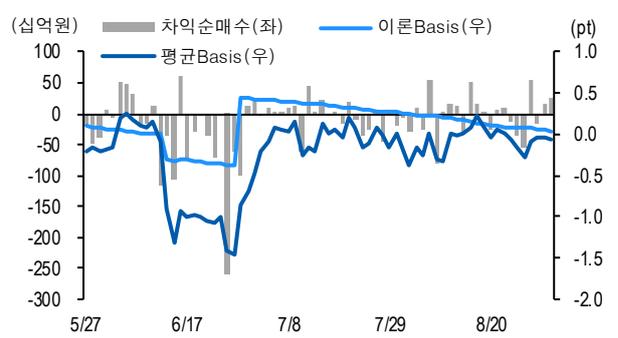
선물옵션시장 지표

2020.9.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.50	0.55	1.69	9,332.3	-
선물 9월물	311.75	0.42	1.30	20,619.4	287,560
선물 12월물	311.25	0.42	1.30	144.6	41,189
9월물(mini)	311.72	0.41	1.22	2,348.8	116,393
10월물(mini)	311.28	0.54	1.66	70.3	27,883

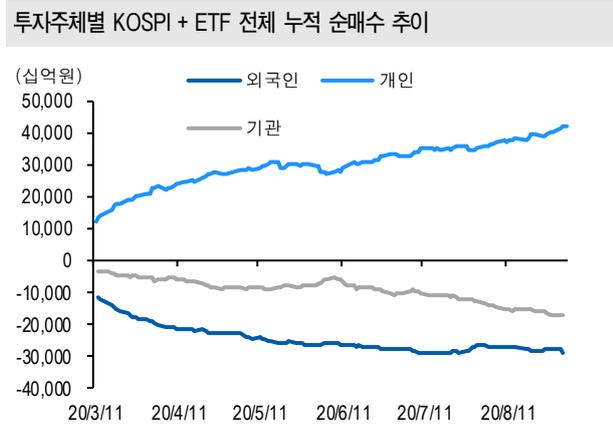


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.04	-0.06	0.25	-0.03%
베이스(mini)	0.04	-0.06	0.22	-0.03%
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.44	-0.45	-0.09%
합성선물 베이스(ATM)	0.04	0.22	0.22	0.06%

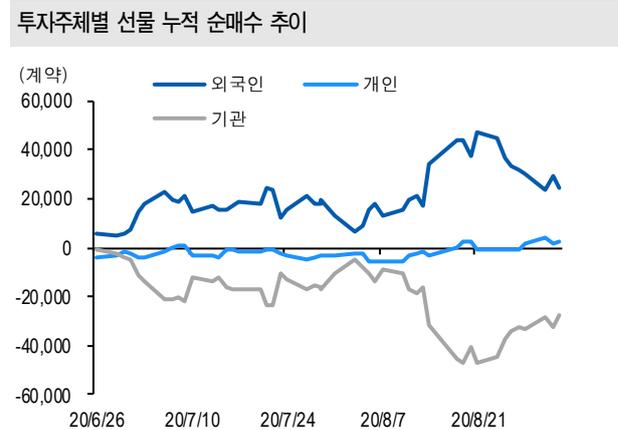


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-256.0	4.7	-251.3	19.1	-181.5	-315.4	-115.1	3.1	0.4	-2.3
개인	334.2	-50.1	284.1	0.0	1.2	68.2	4.7	-2.8	-1.0	-15.9
기관	-79.9	45.5	-34.4	7.8	-25.6	238.1	109.6	1.7	1.4	20.0
금융투자	-4.1	63.0	58.9	0.0	1.7	5.9	109.5	1.8	1.4	20.4
투신	-37.7	-39.5	-77.1	0.0	-5.1	248.4	0.1	0.0	0.0	18.0
은행+보험+기타금융	-11.9	19.1	7.3	0.0	-5.8	-4.7	0.0	0.0	0.0	0.6
연기금+국가지자체	-7.4	-2.9	-10.3	7.8	-11.8	-11.5	0.0	0.0	0.0	-19.0
기타법인	1.7	-0.1	1.6	0.0	0.0	9.1	0.8	-2.1	-0.9	-1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	980,658	311.7	832,180	22.1%	지수옵션 전체	2,100,924	667.6	2,225,824
Put	1,120,266	355.9	1,393,644	25.3%	PCR(금액기준)	1.14	VKOSPI	26.26%(-1.33%p)

	Call				Put										
	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	317.5(K+3)	1.99	-0.16	93,715	15,199	1,159	22.0	Put	312.5(K+1)	4.79	-1.37	7,666	4,678	-143	22.0
	315.0(K+2)	2.87	-0.12	98,954	16,560	-3,513	22.3		310.0(K+0)	3.72	-1.24	21,067	10,726	-296	22.9
	312.5(K+1)	4.02	0.02	36,734	9,187	-161	22.9		307.5(K-1)	2.86	-1.12	44,375	8,686	796	23.7
	310.0(K+0)	5.44	0.07	15,172	8,922	-145	23.8		305.0(K-2)	2.20	-0.98	69,737	12,735	537	24.7
	307.5(K-1)	7.07	0.21	4,817	4,583	-65	24.6		302.5(K-3)	1.70	-0.86	68,317	9,383	624	25.8

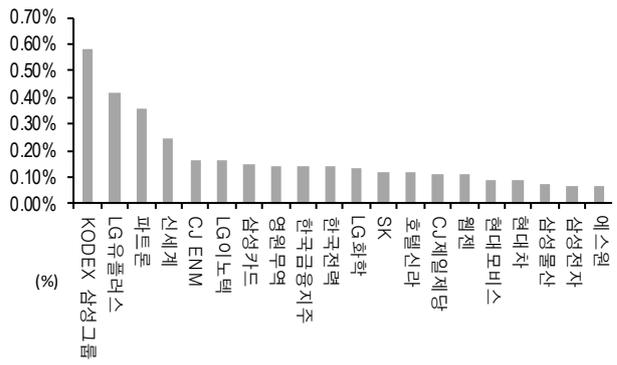
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,504,902	3,027.5	5,862,931	217,426	-46,164	-123,865	177,173	-2.3	-15.9	20.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	176,500	-2.22	381.0	76.7	130,433	-6,819	0.09%	-16	-3,998	5,368	6,989	1,537
대림산업	94,000	-0.32	18.7	71.4	32,694	277	0.04%	-576	476	112	19	-25
기아차	42,250	-2.65	53.7	71.3	58,306	-2,292	-0.09%	1,433	159	-1,607	-2,801	6,586
NAVER	332,500	2.47	186.7	69.9	53,910	-5,614	-0.02%	751	227	-1,329	2,942	-407
LG 화학	744,000	0.00	237.3	69.6	46,756	-3,299	0.13%	-255	161	170	-260	774
카카오	413,500	3.38	253.0	67.4	37,398	-162	-0.27%	1,764	1,254	-3,135	-782	-1,847
삼성전자	54,500	0.55	616.3	66.8	1,235,032	-20,746	0.07%	-3,344	14,681	-11,508	-7,474	-13,412
삼성 SDI	451,000	-0.99	84.6	65.8	21,413	764	-0.04%	-203	354	-520	-444	69
신세계	215,000	5.39	26.1	61.6	10,016	5,002	0.25%	-68	-48	126	-525	-2,452
KB 금융	37,850	0.93	28.2	55.2	99,228	-1,609	0.06%	736	-1,803	1,067	-2,421	3,386

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터