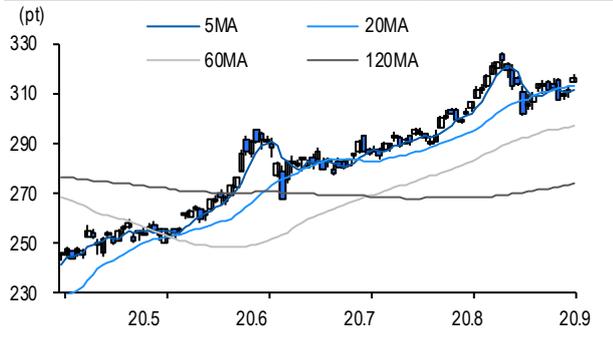
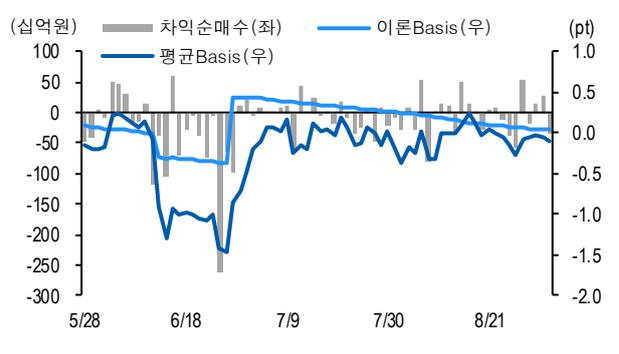


선물옵션시장 지표 2020.9.4

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.43	1.58	4.93	11,427.4	-
선물 9월물	315.90	1.33	4.15	22,225.3	287,573
선물 12월물	315.65	1.41	4.40	258.3	45,144
9월물(mini)	315.80	1.30	4.08	2,098.8	122,561
10월물(mini)	315.62	1.39	4.34	49.8	29,095

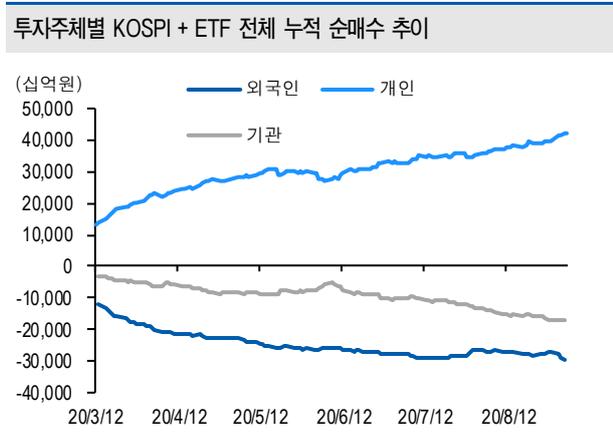


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.04	-0.09	-0.53	-0.04%
베이스스(mini)	0.04	-0.08	-0.63	-0.04%
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.35	-0.30	-0.06%
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	-0.56	-0.56	-0.19%

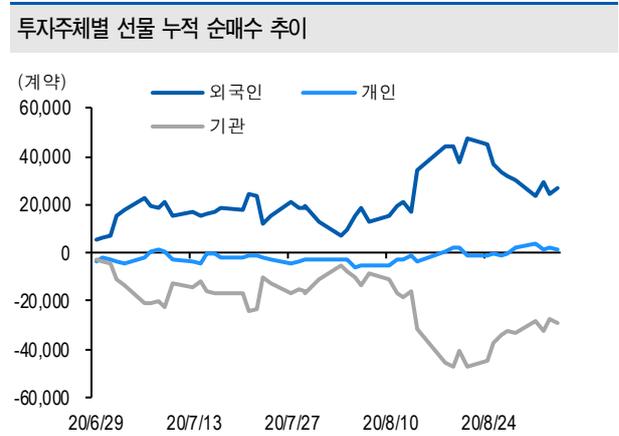


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	194.1	-16.7	177.4	0.0	-4.5	387.0	-172.0	9.3	0.0	-55.5
개인	-96.8	34.7	-62.0	0.0	2.2	-70.2	6.8	-0.8	-1.4	53.9
기관	-133.9	-20.9	-154.8	-32.9	-62.2	-284.4	165.8	-8.6	1.5	2.1
금융투자	-57.2	61.7	4.6	-1.6	-4.0	-607.1	166.1	-8.4	1.6	-45.5
투신	-48.3	-9.8	-58.1	0.0	-14.1	269.7	-0.3	0.1	0.0	79.1
은행+보험+기타금융	-11.2	-37.1	-48.3	0.0	-23.8	27.7	0.0	-0.2	-0.1	1.3
연기금+국가자재	-48.3	-32.9	-81.3	-31.3	-19.3	25.2	0.0	0.0	0.0	-32.8
기타법인	36.6	2.8	39.4	0.0	0.1	-32.4	-0.6	0.0	-0.1	-0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

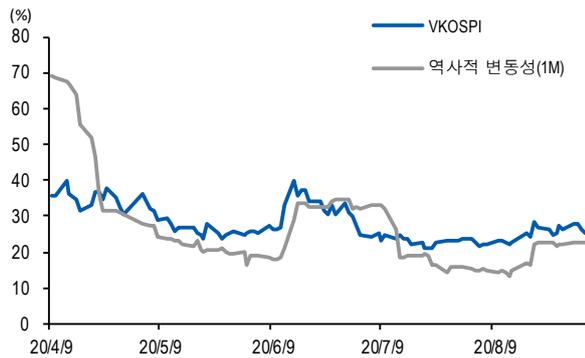
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,146,769	391.5	824,608	19.6%	지수옵션 전체	2,269,576	632.7	2,250,577
Put	1,122,807	241.1	1,425,969	25.0%	PCR(금액기준)	0.62	VKOSPI	25.30%(-0.96%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	2.18	0.85	143,667	24,104	-2,067	19.6	Put	315.0(K+1)	3.58	-2.57	28,658	8,052	1,554	22.9
	317.5(K+2)	3.17	1.18	89,751	16,148	949	19.6		312.5(K+0)	2.67	-2.12	44,998	5,952	1,274	23.5
	315.0(K+1)	4.48	1.61	38,724	16,741	181	19.8		310.0(K-1)	1.97	-1.75	76,524	12,924	2,198	24.2
	312.5(K+0)	6.04	2.02	10,758	9,202	15	20.0		307.5(K-2)	1.46	-1.40	85,094	11,131	2,445	25.1
	310.0(K-1)	7.85	2.41	3,273	8,260	-662	20.3		305.0(K-3)	1.09	-1.11	99,184	15,777	3,042	26.1

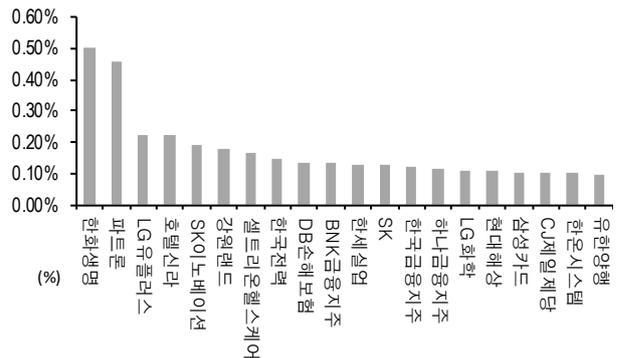
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,597,624	3,914.6	6,148,842	285,911	-53,557	59,618	-8,065	-55.5	53.9	2.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	75,500	-0.66	59.9	72.2	67,802	27,754	0.22%	-5,441	111	5,300	-436	0
삼성전자	56,500	3.67	1,013.8	66.2	1,236,222	1,190	0.09%	-20,446	43,321	-20,077	-64	0
대림산업	91,900	-2.23	18.3	64.8	32,308	-386	0.03%	-1,274	1,681	-439	632	0
SK 하이닉스	78,700	4.24	353.7	64.3	208,342	46,277	0.05%	-17,166	2,387	14,767	-725	0
NAVER	339,000	1.95	166.8	64.2	53,082	-828	0.02%	-1,465	120	1,335	-2,204	395
LG 이노텍	163,000	-3.26	26.8	60.3	29,725	1,818	-0.05%	-1,378	85	1,295	-613	0
LG 화학	768,000	3.23	315.1	60.1	47,489	733	0.11%	-1,533	2,218	-693	-64	0
현대차	177,000	0.28	189.1	58.6	127,668	-2,765	0.08%	-158	6,314	-6,172	-372	-210
기아차	42,750	1.18	34.1	58.3	60,495	2,189	-0.01%	4,087	2,402	-6,485	-990	75
삼성 SDI	452,000	0.22	102.1	57.7	20,459	-954	0.03%	-63	-223	628	1,556	-1,900

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터