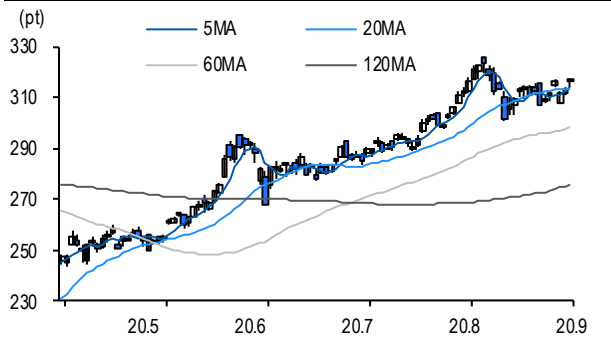


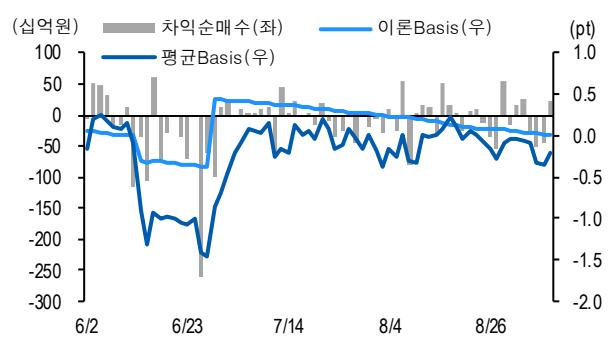


선물옵션시장 지표 2020.9.9

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.38	1.18	3.71	10,558.5	-
선물 9월물	317.35	1.21	3.80	20,344.7	215,919
선물 12월물	316.95	1.23	3.85	1,366.3	161,010
9월물(mini)	317.38	1.22	3.78	1,783.0	147,722
10월물(mini)	317.18	1.35	4.22	138.9	42,376

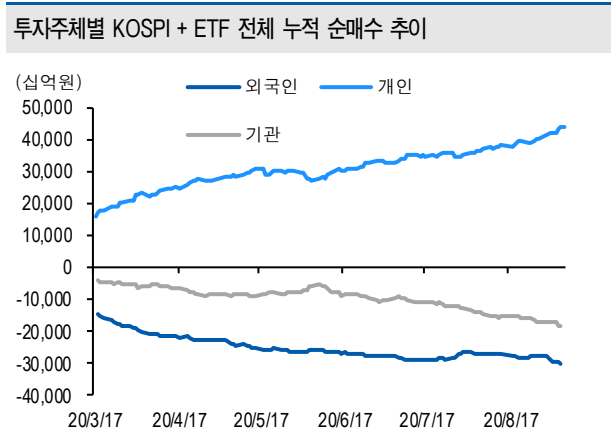


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.01	-0.21	-0.03	-0.07%
베이스스(mini)	0.01	-0.21	0.00	-0.07%
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.41	-0.40	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.03	-0.03	-0.01%

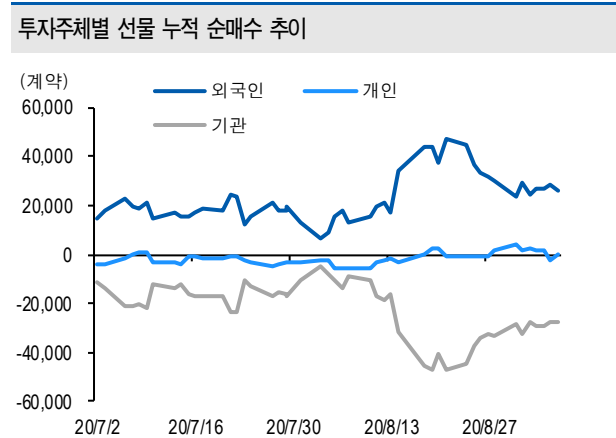


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-30.5	18.0	-12.4	0.0	-313.1	-227.9	54.0	6.5	0.6	-6.4
개인	35.9	-9.2	26.8	0.0	-1.0	195.6	-5.8	-1.4	-1.6	38.2
기관	-22.0	3.6	-18.4	22.7	-155.4	26.6	-48.1	-4.2	1.7	-34.0
금융투자	55.7	38.3	93.9	-9.5	-35.0	5.7	-47.9	-2.8	1.7	-69.9
투신	-81.7	2.4	-79.3	0.0	-47.2	98.5	-0.2	-1.3	0.0	51.2
은행+보험+기타금융	-31.3	-19.5	-50.9	0.7	-32.7	-14.6	0.0	0.0	0.0	0.3
연기금+국가자재	63.4	-7.3	56.1	31.5	-25.3	-63.0	0.0	0.0	0.0	-15.6
기타법인	16.6	-12.5	4.1	0.0	-0.3	5.6	-0.1	-0.9	-0.7	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

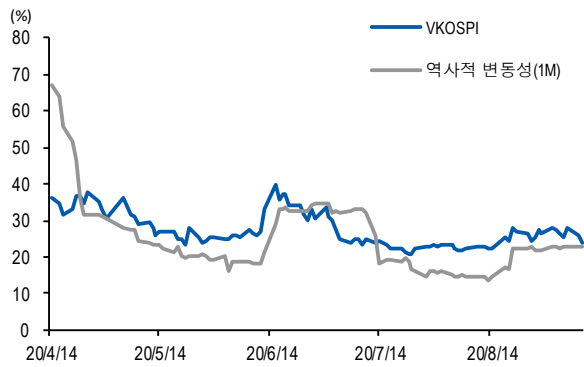
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,316,391	310.0	919,463	20.4%	지수옵션 전체	2,790,613	550.5	2,533,381
Put	1,474,222	240.5	1,613,918	25.4%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	23.87%(-1.98%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.22	0.50	234,699	26,718	-1,987	19.9	Put	315.0(K+1)	1.53	-2.28	96,615	14,253	6,125	22.3
	317.5(K+2)	2.31	0.96	179,504	21,471	167	20.6		312.5(K+0)	0.90	-1.80	138,684	12,205	4,826	23.4
	315.0(K+1)	3.87	1.54	74,018	18,468	-183	21.8		310.0(K-1)	0.53	-1.37	152,787	20,126	6,149	24.7
	312.5(K+0)	5.75	2.03	11,210	9,807	-567	22.8		307.5(K-2)	0.30	-1.03	118,596	21,494	9,032	25.9
	310.0(K-1)	7.86	2.44	4,648	10,537	-415	23.7		305.0(K-3)	0.18	-0.76	150,143	27,415	7,352	27.5

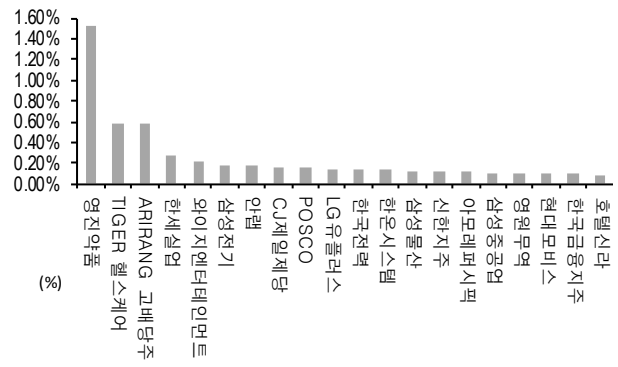
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,850,796	4,409.7	6,372,991	29,631	-124,713	46,206	79,591	-6.4	38.2	-34.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	162,500	2.52	27.6	88.0	23,184	-1,756	0.08%	-2,182	743	1,431	1,378	5
GS 건설	25,650	-0.77	9.6	82.3	27,320	-17,078	0.00%	2,658	-2,943	283	-1,292	1,594
삼성 SDI	435,000	1.16	103.1	73.4	17,230	-1,014	0.02%	-524	1,074	-1,171	-375	54
기아차	42,150	-0.47	29.0	67.2	43,172	-13,646	0.02%	-9,107	-1,015	10,122	6,755	2,934
현대차	168,000	-0.88	212.1	65.4	96,458	-6,826	0.04%	-1,065	-285	1,350	2,579	-1,638
대림산업	96,900	-0.10	23.3	63.1	19,110	-6,107	-0.04%	-786	-3,470	3,891	2,857	946
LG 전자	85,800	2.26	70.5	60.5	27,681	8,826	0.01%	-353	12,776	-12,692	-7,217	-5,894
삼성전자	58,700	4.08	1,080.1	59.3	897,596	-172,409	0.05%	-11,979	790	14,410	-74,274	28,106
LG 화학	711,000	-1.11	318.4	55.6	26,859	-8,647	0.06%	5,241	1,252	-6,515	-1,300	-3,987
KB 금융	37,750	-1.05	39.0	55.2	42,888	-32,329	0.05%	-5,726	-11,333	20,703	4,314	13,032

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터