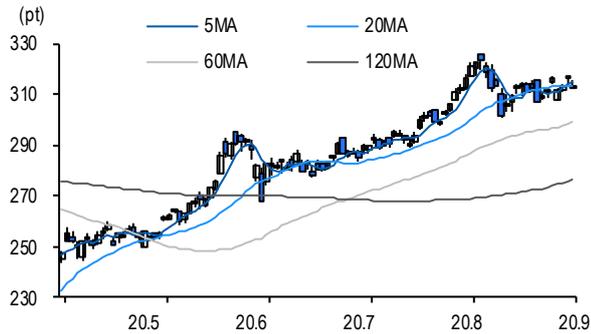
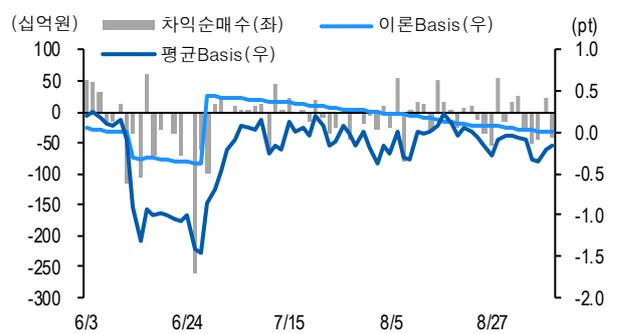


선물옵션시장 지표 2020.9.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.77	-1.14	-3.61	10,510.5	-
선물 9월물	313.35	-1.26	-4.00	19,877.1	141,794
선물 12월물	311.45	-1.74	-5.50	3,252.3	233,016
9월물(mini)	313.56	-1.20	-3.82	1,849.8	149,032
10월물(mini)	313.00	-1.32	-4.18	183.6	49,833

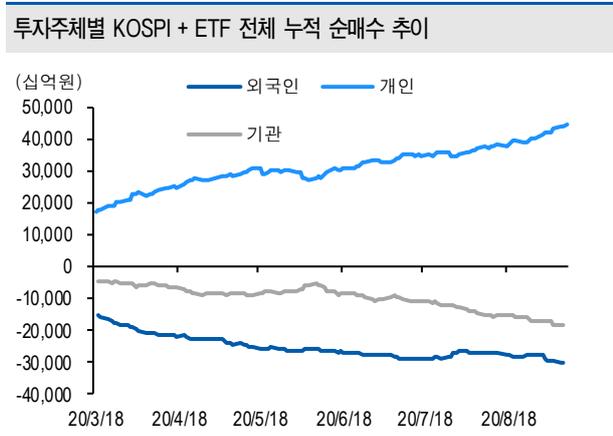


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.01	-0.17	-0.42	-0.06%	
베이스스(mini)	0.01	-0.17	-0.21	-0.06%	
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.53	-0.55	-0.12%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.29	-0.29	-0.09%	

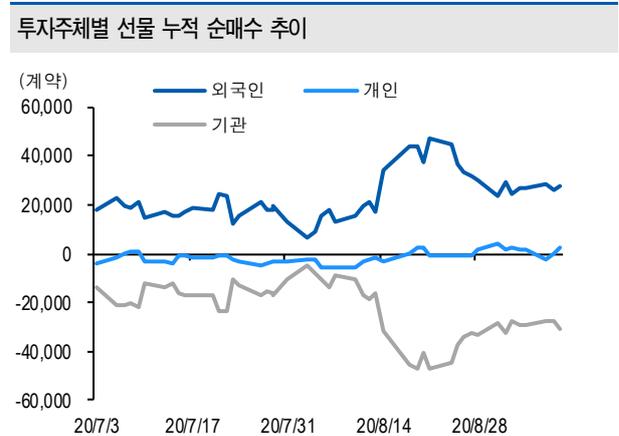


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-117.6	2.7	-114.9	3.0	-222.7	126.4	-45.7	1.4	6.0	2.7
개인	515.8	35.4	551.3	0.0	-0.2	142.2	25.9	0.0	-3.2	-68.9
기관	-430.8	-47.9	-478.6	-45.3	-177.6	-249.1	20.0	1.8	-0.9	65.3
금융투자	-96.1	-47.0	-143.1	-15.7	-19.2	29.4	20.0	3.1	0.5	33.9
투신	-92.4	-18.4	-110.9	0.0	-54.4	-301.5	0.0	-2.7	-0.1	-34.2
은행+보험+기타금융	1.0	6.8	7.7	0.0	-7.9	-30.0	0.0	1.5	-1.3	0.6
연기금+국가자재	-184.8	14.3	-170.5	-29.6	-51.1	52.9	0.0	0.0	0.0	64.9
기타법인	32.5	9.7	42.2	0.0	-1.2	-19.4	-0.1	-3.2	-1.9	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,325,312	280.0	964,985	20.7%	지수옵션 전체	2,946,516	585.7	2,618,095			
Put	1,621,204	305.8	1,653,110	25.1%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	24.73%(+0.86%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.03	-0.26	130,217	49,022	13,815	22.1	Put	320.0(K+1)	6.73	2.83	3,080	4,143	133	26.4
	322.5(K+2)	0.07	-0.55	224,942	29,457	4,305	20.6		317.5(K+0)	4.60	2.11	22,554	7,434	-414	24.4
	320.0(K+1)	0.22	-1.00	285,338	34,294	7,576	20.4		315.0(K-1)	2.87	1.34	97,611	14,670	417	23.8
	317.5(K+0)	0.58	-1.73	272,012	26,675	5,204	20.2		312.5(K-2)	1.67	0.77	177,975	14,520	2,315	24.4
	315.0(K-1)	1.38	-2.49	180,051	23,626	5,158	20.8		310.0(K-3)	0.92	0.39	226,896	19,124	-1,002	25.4

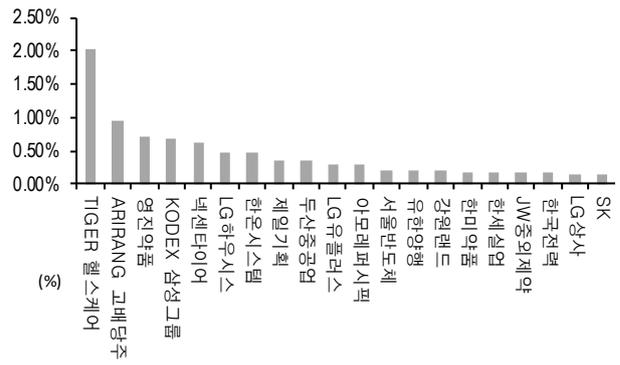
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,028,441	4,285.6	6,325,344	-47,647	-6,150	-117,942	120,135	2.7	-68.9	65.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	25,250	-1.56	5.5	71.8	14,444	-12,876	-0.11%	-2,058	497	1,561	989	856
삼성 SDI	430,000	-1.15	82.2	69.0	9,477	-7,753	-0.01%	-280	-428	1,051	-43	1,965
삼성전자	58,500	-0.34	1,168.0	66.1	589,485	-308,111	0.01%	-127	-55,182	49,216	-16,869	16,880
LG 이노텍	166,000	2.15	35.1	64.2	14,714	-8,470	-0.04%	-2,234	-650	2,915	1,809	527
SK 하이닉스	77,600	-2.14	166.8	55.5	118,462	-63,381	0.03%	-501	-34,325	36,394	8,340	33,610
LG 전자	90,600	5.59	169.8	53.4	14,625	-13,056	0.00%	1,847	-4,596	2,809	850	-1,030
현대차	168,000	0.00	144.9	51.7	56,549	-39,909	0.10%	-172	-118	291	-72	5,254
NAVER	304,500	-2.09	136.0	48.8	30,273	-6,141	0.04%	1,312	92	-1,405	2,492	-3,481
대림산업	95,500	-1.44	23.5	48.4	15,707	-3,403	0.00%	362	2,285	-2,585	-48	-1,437
삼성전기	143,500	0.00	74.4	46.1	37,688	-4,074	0.01%	-2,312	-1,377	3,558	260	728

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터