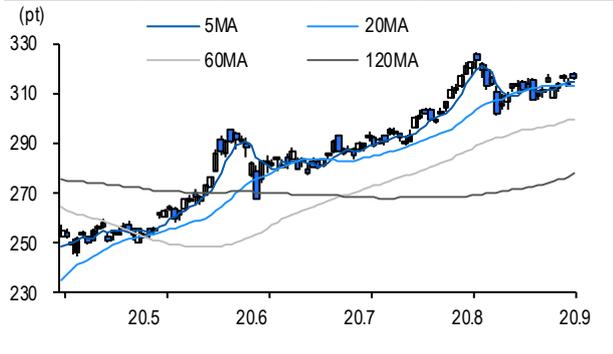


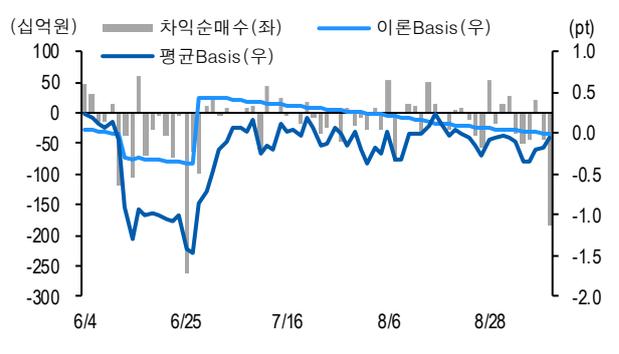


선물옵션시장 지표 2020.9.11

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.53	0.88	2.76	9,908.5	-
선물 9월물	317.50	1.32	4.15	12,213.8	0
선물 12월물	315.55	1.32	4.10	11,661.2	273,995
9월물(mini)	317.48	1.31	3.92	1,104.6	0
10월물(mini)	315.70	0.86	2.70	939.3	57,255

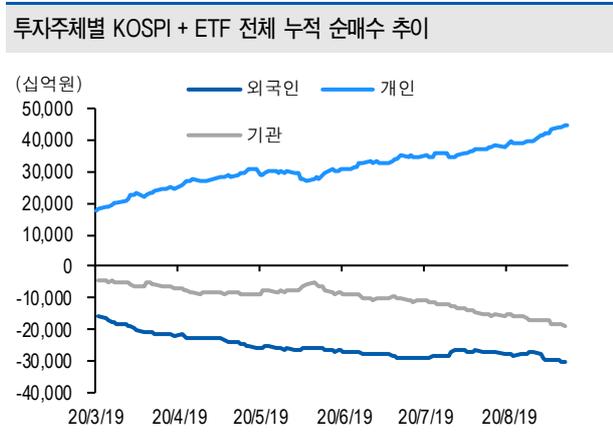


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.00	-0.05	0.97	-0.02%	
베이스스(mini)	0.00	-0.05	0.95	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.89	-1.10	-0.24%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	0.94	0.94	0.30%	

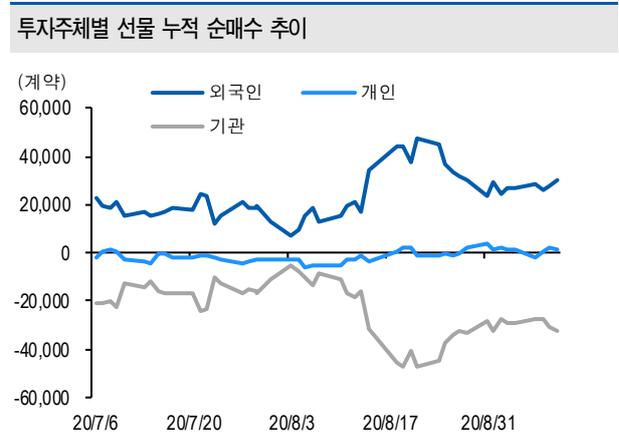


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	381.8	20.9	402.7	4.3	-45.4	177.8	38.0	20.1	3.2	-30.1
개인	66.3	-10.7	55.6	0.0	-0.7	-57.9	-6.0	-10.1	-1.3	38.1
기관	-472.1	-2.0	-474.1	-187.8	-239.3	-117.5	-32.0	-5.3	0.9	-11.1
금융투자	-119.4	8.0	-111.4	-140.2	60.2	-83.0	-31.6	0.7	1.4	4.6
투신	-97.3	13.0	-84.3	-12.7	-96.2	-55.2	-0.5	-5.1	0.0	35.8
은행+보험+기타금융	-20.8	-24.1	-45.0	0.1	-30.7	-23.1	0.1	-0.9	-0.5	4.4
연기금+국가자차체	-205.9	-18.2	-224.1	-35.1	-138.8	43.7	0.0	0.0	0.0	-56.0
기타법인	24.0	-8.2	15.8	0.0	0.0	-2.4	0.0	-4.7	-2.8	3.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,698,312	317.8	462,010	15.7%	지수옵션 전체	3,654,328	553.6	1,163,635
Put	1,956,016	235.7	701,625	12.2%	PCR(금액기준)	0.74	VKOSPI	22.14%(-2.59%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	0.01	-0.06	174,954	0	-29,457	15.6	Put	317.5(K+1)	0.59	-4.01	267,756	0	-7,434	10.5
	320.0(K+2)	0.05	-0.17	626,457	0	-34,294	13.0		315.0(K+0)	0.04	-2.83	520,658	0	-14,670	6.6
	317.5(K+1)	0.56	-0.02	512,235	0	-26,675	14.6		312.5(K-1)	0.01	-1.66	467,400	0	-14,520	11.3
	315.0(K+0)	2.51	1.13	166,762	0	-23,626	24.7		310.0(K-2)	0.01	-0.91	256,237	0	-19,124	17.2
	312.5(K-1)	4.70	2.05	24,665	0	-12,940	31.8		307.5(K-3)	0.01	-0.46	121,587	0	-25,388	23.0

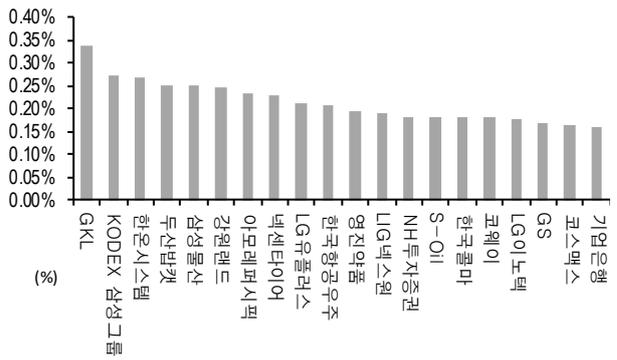
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,815,769	4,599.9	5,133,981	-1,191,363	-61,837	102,306	-47,265	-30.1	38.1	-11.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한세실업	16,900	-0.29	3.3	56.6	0	-17,794	-0.23%	-546	984	-417	-981	825
현대차	169,500	0.89	87.1	38.9	0	-56,549	-0.11%	625	-968	344	-1,644	886
삼성 SDI	432,500	0.58	44.2	35.6	0	-9,477	-0.03%	-967	-519	1,784	2,370	163
와이지엔터테 인먼트	57,600	-0.17	9.5	35.0	0	-13,739	0.07%	760	-362	-392	-3,490	-185
NAVER	308,500	1.31	84.7	33.2	0	-30,273	-0.04%	-394	2,021	-1,603	3,846	-4,530
GS 건설	25,350	0.40	2.7	30.9	0	-14,444	0.10%	-2,205	2,116	92	-1,242	1,321
삼성전기	143,500	0.00	44.6	30.4	0	-37,688	-0.20%	-1,471	-317	1,966	728	-167
SK 하이닉스	76,700	-1.16	82.5	30.3	0	-118,462	-0.08%	1,420	-1,353	-84	10,785	12,904
포스코케미칼	87,300	0.81	8.4	29.0	0	-13,186	-0.01%	-99	-305	405	2,421	-874
삼성전자	59,600	1.88	497.5	28.0	0	-589,485	-0.03%	-22,780	35,841	-19,480	-43,328	-61,281

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

