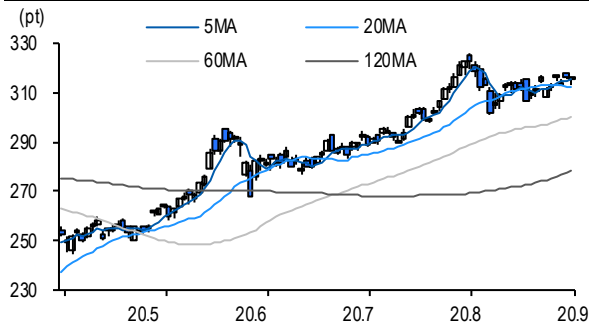


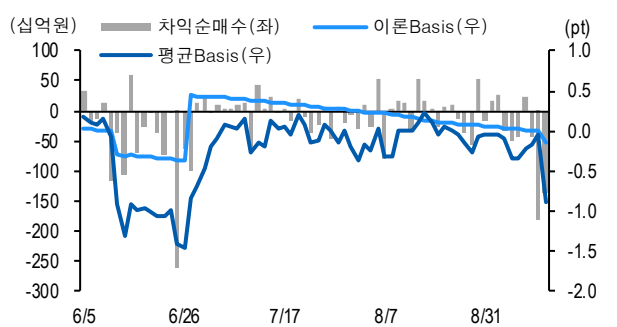
선물옵션시장 지표

2020.9.14

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.45	-0.03	-0.08	6,992.4	-
선물 12월물	315.75	0.06	0.20	17,914.9	268,315
선물 3월물	312.75	0.00	0.00	5.4	4,141
10월물(mini)	315.94	0.08	0.24	1,718.7	60,380
11월물(mini)	315.88	-0.24	-0.76	13.1	278

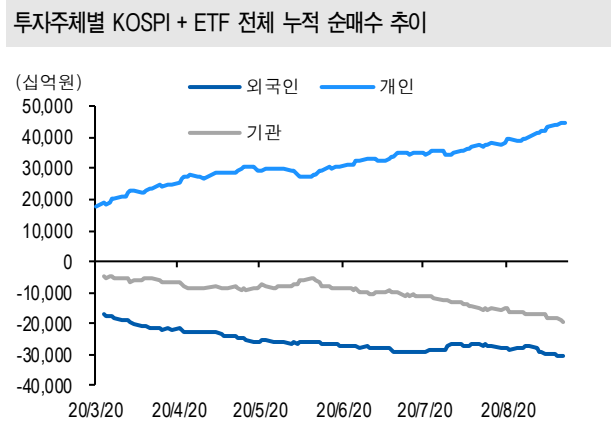


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.16	-0.89	-0.70	-0.23%	
베이스스(mini)	0.15	-0.72	-0.51	-0.27%	
제1스프레드(SP)	-3.45	-3.06	-3.10	0.12%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	-0.57	-0.57	-0.23%	

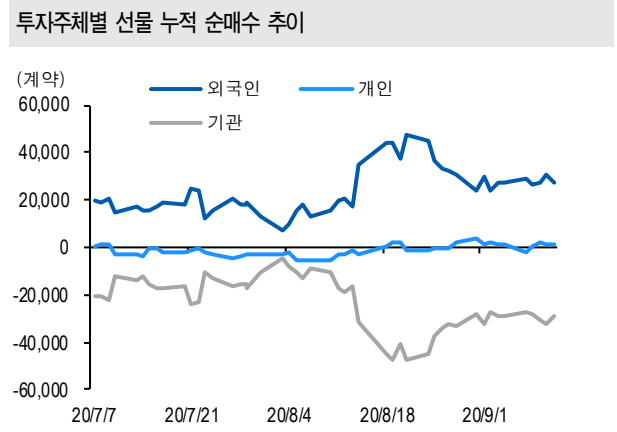


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-164.1	-47.3	-211.4	-75.2	-170.0	258.4	-68.6	-4.2	0.1	7.1
개인	452.3	-21.5	430.8	0.0	0.2	14.6	-29.2	2.2	0.3	4.2
기관	-323.7	66.1	-257.7	-60.1	-171.3	-281.5	98.0	2.3	-0.3	-13.6
금융투자	-128.4	19.8	-108.5	-72.4	-33.7	124.7	97.9	4.6	2.1	-30.8
투신	-58.6	-3.5	-62.1	0.0	-30.4	-229.5	0.0	-2.2	-2.3	-10.7
은행+보험+기타금융	-7.4	30.7	23.3	-0.3	-7.7	-58.9	0.0	-0.1	-0.1	4.5
연기금+국가자재	-96.1	-0.2	-96.2	12.5	-85.7	-117.8	0.1	0.0	0.0	23.3
기타법인	35.6	2.7	38.3	0.0	-0.2	8.5	-0.1	-0.3	-0.1	2.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





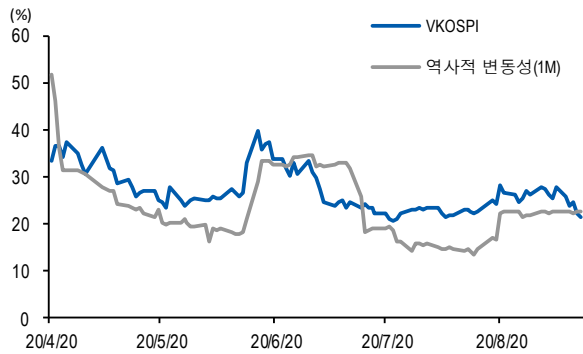
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	462,860	181.3	528,292	17.7%	지수옵션 전체	1,041,871	401.7	1,321,920
Put	579,011	220.4	793,628	19.6%	PCR(금액기준)	1.22	VKOSPI	21.68%(-0.46%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	2.70	-0.09	51,073	10,553	3,350	17.5	Put	320.0(K+1)	8.63	-0.09	687	1,933	39	18.2
	322.5(K+2)	3.53	-0.07	30,053	5,459	1,760	17.8		317.5(K+0)	7.29	-0.36	1,830	1,044	177	18.6
	320.0(K+1)	4.52	-0.05	25,376	6,309	1,842	18.0		315.0(K-1)	6.11	-0.37	9,278	5,482	2,732	18.9
	317.5(K+0)	5.67	-0.07	9,929	5,640	2,391	18.3		312.5(K-2)	5.13	-0.39	6,152	3,346	789	19.4
	315.0(K-1)	7.02	-0.06	9,739	5,011	2,321	18.7		310.0(K-3)	4.30	-0.34	12,587	8,300	1,743	19.9

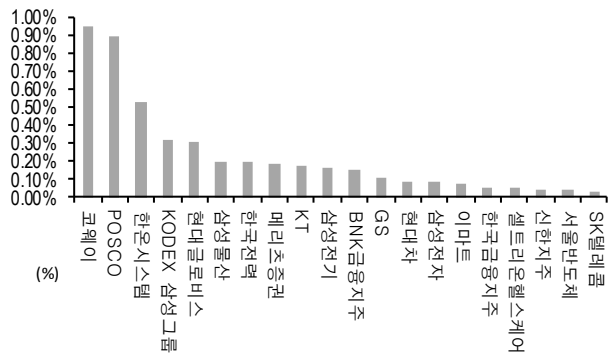
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,909,112	2,773.5	5,295,836	161,855	-3,637	-1,136	1,718	7.1	4.2	-13.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	169,500	0.00	25.7	88.2	20,363	1,859	-0.32%	-663	168	501	-401	675
삼성전자	58,800	-0.34	686.2	73.0	1,509,258	-27,999	0.09%	7,098	-1,841	-5,441	-19,194	27,615
현대차	173,000	1.76	185.0	71.2	100,687	1,780	0.09%	1,537	410	-1,917	1,668	-2,568
LG 전자	92,700	-1.07	94.9	69.0	38,327	459	-0.04%	-7,212	802	6,474	4,603	1,015
NAVER	307,000	-0.32	102.3	65.4	41,760	-1,751	-0.02%	43	-529	478	-800	2,515
LG 화학	706,000	-0.98	164.1	65.0	35,935	-1,324	-0.49%	-694	508	191	-718	2,070
SK 하이닉스	78,500	2.35	140.6	64.0	155,195	13,363	0.03%	3,631	5,471	-10,240	-5,615	-5,721
호텔신라	75,000	3.88	46.2	61.7	60,914	5,333	0.02%	914	4,255	-7,019	-3,424	-4,394
엔씨소프트	819,000	-1.56	50.4	61.6	3,586	173	-0.19%	25	-271	247	99	-95
셀트리온	299,500	0.00	153.8	50.3	47,785	6,850	-0.14%	2,756	-300	-2,460	-4,801	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

