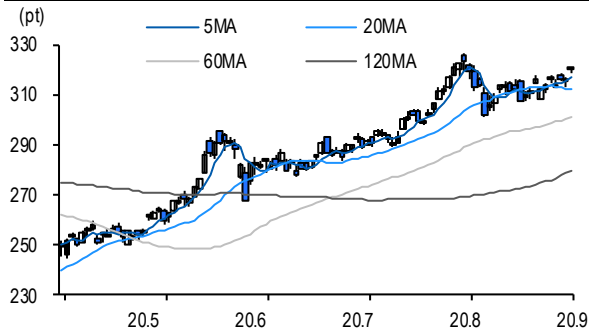




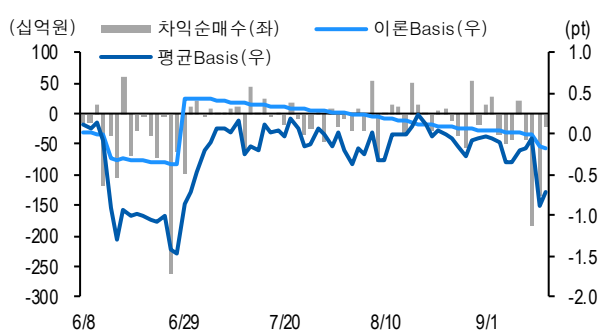
선물옵션시장 지표

2020.9.15

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	320.98	1.43	4.53	7,624.1	-	
KSP2012	320.00	1.35	4.25	13,089.0	270,341	
KSP2103	317.10	1.39	4.35	7.0	4,138	
KSP2009(mini)	320.14	1.33	4.20	1,649.2	66,994	
KSP2010(mini)	319.88	1.27	4.00	2.3	267	

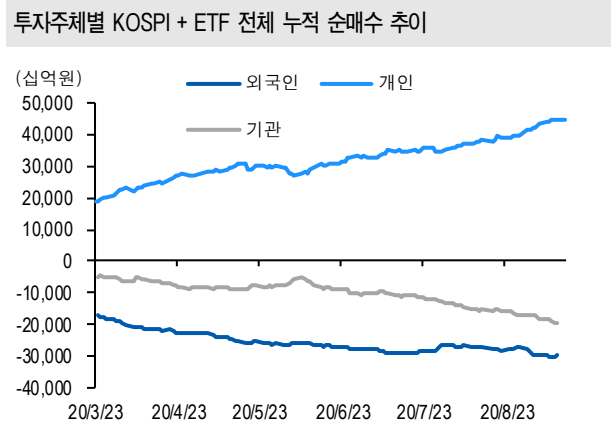


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.17	-0.72	-0.98	-0.17%	
베이스스(mini)	0.13	-0.66	-0.84	-0.25%	
제1스프레드(SP)	-3.44	-3.20	-3.20	0.07%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.13	-0.90	-0.90	-0.32%	

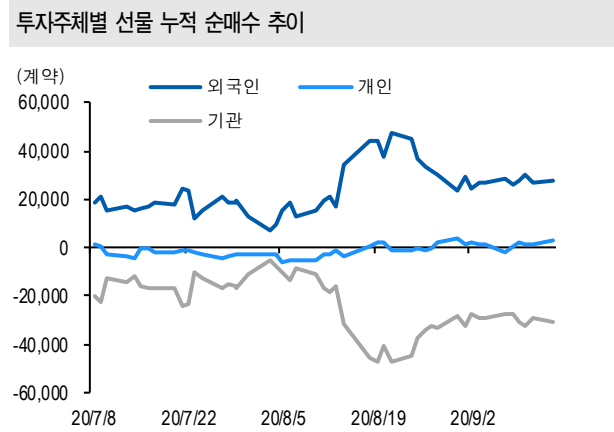


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	142.5	-31.6	110.9	0.0	33.6	-122.0	153.6	1.6	-2.7	5.4	
개인	-287.3	-0.6	-287.9	0.0	1.0	129.0	5.3	0.3	-1.3	124.0	
기관	95.4	38.6	134.1	-19.3	-206.6	-19.2	-159.0	-1.6	4.7	-131.9	
금융투자	194.4	154.1	348.4	-44.7	-9.5	-252.4	-159.6	-1.5	4.6	-51.9	
투신	-47.0	-9.9	-56.9	0.0	-20.2	293.3	0.5	0.0	0.1	30.6	
은행+보험+기타금융	29.4	-67.4	-37.9	0.0	-10.0	11.3	0.0	-0.1	0.0	0.2	
연기금+국가자재	-83.0	-40.6	-123.6	25.4	-153.7	-71.4	0.0	0.0	0.0	-110.9	
기타법인	49.4	-6.5	42.9	0.0	3.6	12.2	0.1	-0.3	-0.7	2.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





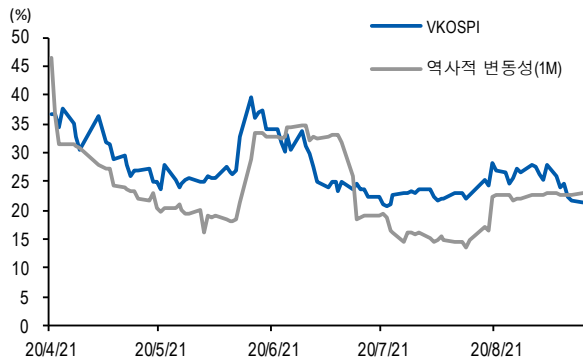
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	425,108	184.6	547,379	17.3%	Option total	926,465	311.5	1,401,066
Put	501,357	126.9	853,687	20.3%	PCR(Val. base)	0.69	VKOSPI	21.28%(-0.40%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	3.90	1.20	39,379	14,173	3,620	17.5	Put	320.0(K+1)	6.08	-2.55	2,604	2,379	446	18.9
	322.5(K+2)	4.90	1.37	11,318	5,641	182	17.5		317.5(K+0)	5.02	-2.27	3,806	1,558	514	19.2
	320.0(K+1)	6.14	1.62	8,314	5,676	-633	17.7		315.0(K-1)	4.13	-1.98	7,313	6,342	860	19.6
	317.5(K+0)	7.60	1.93	2,741	5,443	-197	18.0		312.5(K-2)	3.38	-1.75	15,073	3,919	573	20.0
	315.0(K-1)	9.20	2.18	1,521	4,797	-214	18.3		310.0(K-3)	2.80	-1.50	18,449	9,271	971	20.6

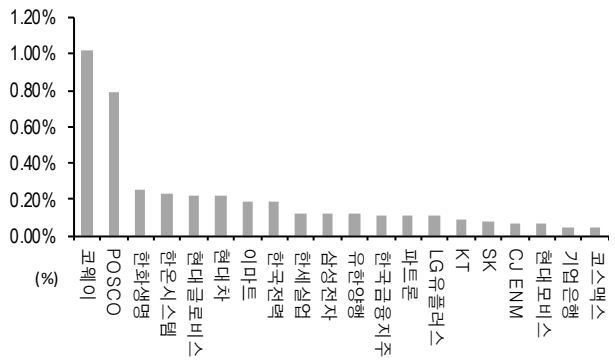
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,702,951	2,722.9	5,560,322	264,486	-8,324	180,410	-177,410	5.4	124.0	-131.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	436,000	1.75	109.1	83.1	16,802	738	0.00%	626	210	-1,050	768	-2,745
삼성전자	60,200	2.38	841.9	68.1	1,639,268	130,010	0.12%	-1,021	106,355	-108,503	-53,015	-71,408
LG 화학	712,000	0.85	141.3	61.3	35,658	-277	-0.17%	245	1,543	-1,794	-718	-185
LG 이노텍	170,000	0.29	11.6	61.2	20,752	389	-0.11%	834	12	-846	0	-795
현대차	180,500	4.34	330.1	59.3	119,659	18,972	0.22%	2,895	3,923	-7,080	31	-14,439
LG 전자	92,200	-0.54	66.3	58.4	35,196	-3,131	-0.08%	-3,449	-58	3,506	156	4,625
NAVER	303,500	-1.14	93.2	50.9	42,442	682	0.04%	-667	1,108	-440	-1,675	1,312
LG 디스플레이	16,450	-1.20	24.6	47.8	272,480	14,773	-0.96%	-12,972	-6,612	18,604	4,737	1,530
엔씨소프트	826,000	0.85	27.9	47.0	4,173	587	-0.16%	-154	39	76	106	-379
한국금융지주	78,300	-0.51	15.3	46.9	53,797	605	0.11%	-200	400	-188	1,036	-2,524

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

