

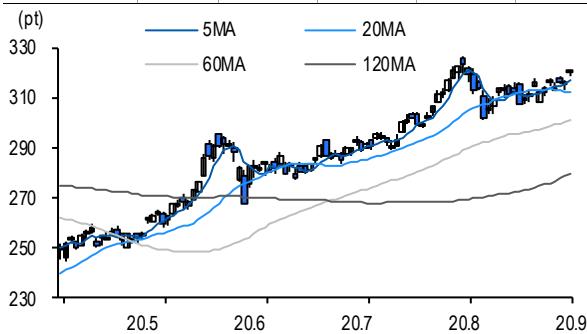
## 선물옵션시장 지표

2020.9.15

### Market Data

(십억원, 계약)

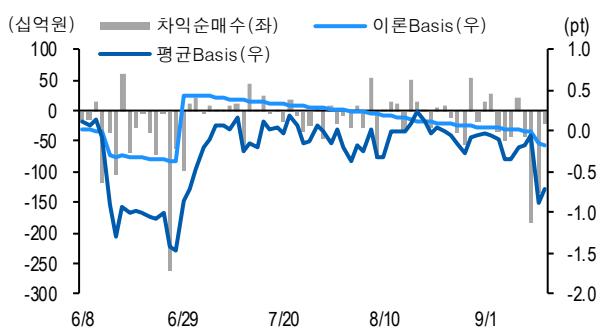
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	320.98	1.43	4.53	7,624.1	-
KSP2012	320.00	1.35	4.25	13,089.0	270,341
KSP2103	317.10	1.39	4.35	7.0	4,138
KSP2009(mini)	320.14	1.33	4.20	1,649.2	66,994
KSP2010(mini)	319.88	1.27	4.00	2.3	267



### 차익거래 관련 Market data

(pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-0.17	-0.72	-0.98	-0.17%
베이시스(mini)	0.13	-0.66	-0.84	-0.25%
제1스프레드(SP)	-3.44	-3.20	-3.20	0.07%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-0.90	-0.90	-0.32%



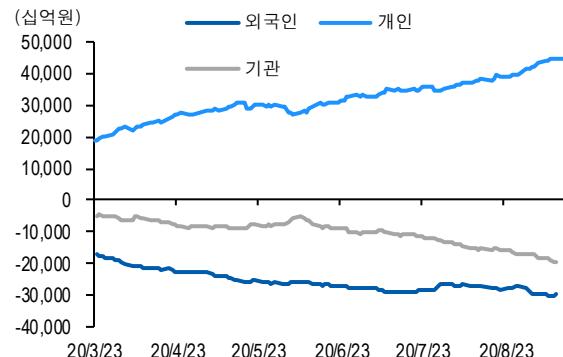
### 투자주체별 매매 동향

(십억원)

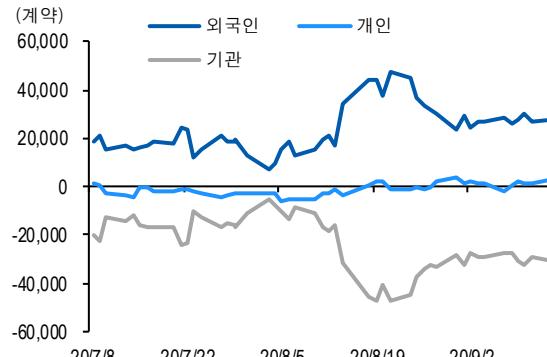
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	142.5	-31.6	110.9	0.0	33.6	-122.0	153.6	1.6	-2.7	5.4
개인	-287.3	-0.6	-287.9	0.0	1.0	129.0	5.3	0.3	-1.3	124.0
기관	95.4	38.6	134.1	-19.3	-206.6	-19.2	-159.0	-1.6	4.7	-131.9
금융투자	194.4	154.1	348.4	-44.7	-9.5	-252.4	-159.6	-1.5	4.6	-51.9
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+국가지자체	-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

### 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



### 투자주체별 선물 누적 순매수 추이

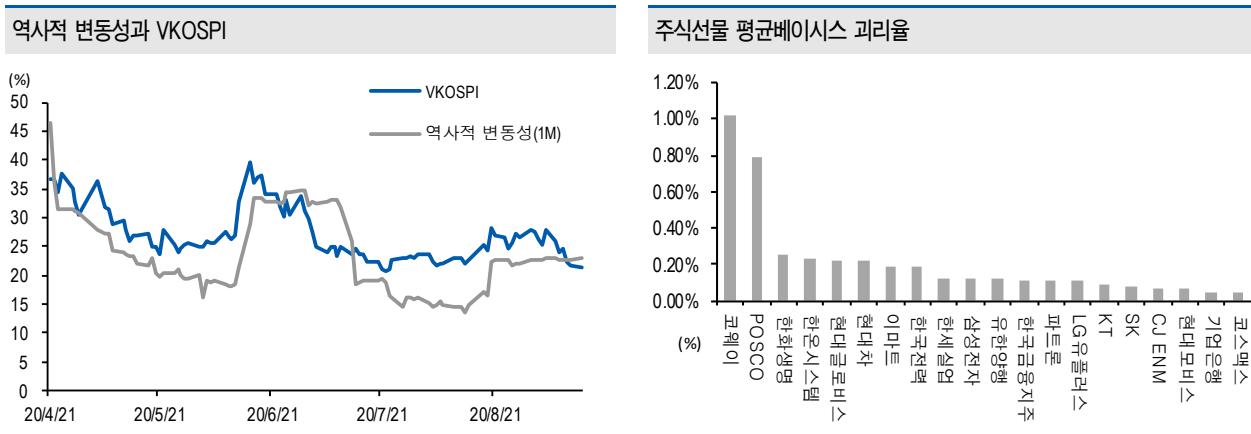


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

(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	종가	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



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

(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
삼성 SDI	436,000	1.75	109.1	83.1	16,802	738	0.00%	626	210	-1,050
삼성전자	60,200	2.38	841.9	68.1	1,639,268	130,010	0.12%	-1,021	106,355	-108,503
LG 화학	712,000	0.85	141.3	61.3	35,658	-277	-0.17%	245	1,543	-1,794
LG 이노텍	170,000	0.29	11.6	61.2	20,752	389	-0.11%	834	12	-846
현대차	180,500	4.34	330.1	59.3	119,659	18,972	0.22%	2,895	3,923	-7,080
LG 전자	92,200	-0.54	66.3	58.4	35,196	-3,131	-0.08%	-3,449	-58	3,506
NAVER	303,500	-1.14	93.2	50.9	42,442	682	0.04%	-667	1,108	-440
LG 디스플레이	16,450	-1.20	24.6	47.8	272,480	14,773	-0.96%	-12,972	-6,612	18,604
엔씨소프트	826,000	0.85	27.9	47.0	4,173	587	-0.16%	-154	39	76
한국금융지주	78,300	-0.51	15.3	46.9	53,797	605	0.11%	-200	400	-188

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표