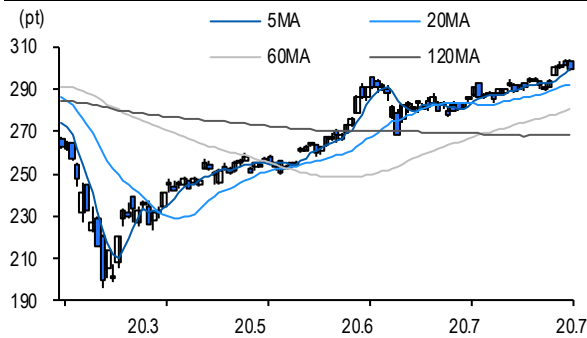


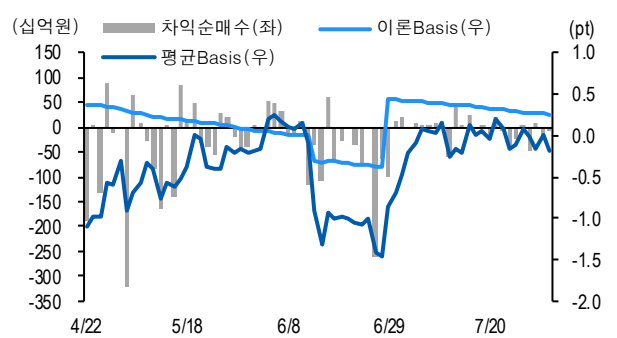


선물옵션시장 지표 2020.8.3

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	299.32	-0.84	-2.53	8,351.1	-
선물 9월물	299.35	-0.81	-2.45	20,773.5	302,563
선물 12월물	298.90	-0.85	-2.55	19.3	38,418
8월물(mini)	299.46	-0.79	-2.38	1,939.7	65,537
9월물(mini)	299.30	-0.83	-2.54	73.4	23,169

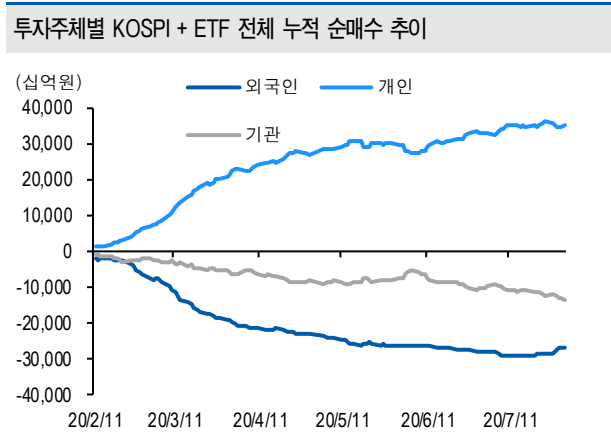


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.26	-0.19	0.03	-0.15%	
베이스스(mini)	0.08	-0.16	0.14	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.53	-0.55	-0.15%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	0.14	0.14	0.02%	

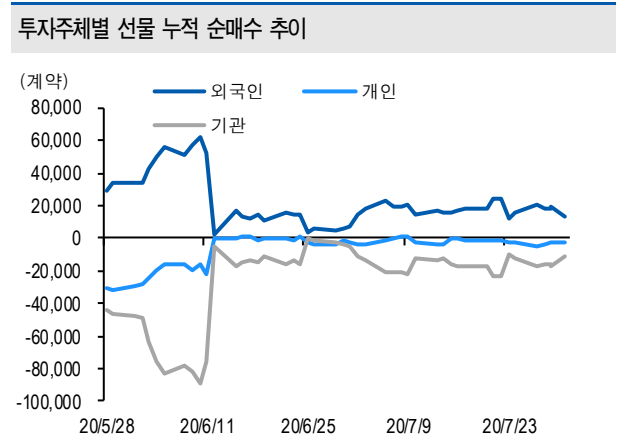


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-85.9	10.6	-75.3	0.0	-231.7	-194.6	-193.4	-1.4	-2.5	-17.9
개인	471.1	9.4	480.6	0.0	-0.7	-22.3	18.2	1.7	-0.1	-5.4
기관	-393.0	-19.0	-412.0	-7.7	-76.1	215.1	174.0	-0.4	2.6	24.8
금융투자	-265.9	111.9	-154.0	0.0	-11.6	348.0	173.8	-0.2	2.2	39.0
투신	-44.1	-51.0	-95.0	0.0	-28.7	-179.5	0.2	-0.1	0.4	-24.3
은행+보험+기타금융	-14.1	-38.6	-52.7	0.0	-6.9	40.1	0.0	0.0	0.0	-0.7
연기금+국가지자체	-38.3	-3.8	-42.1	-7.7	-7.2	6.6	0.0	0.0	0.0	10.7
기타법인	7.7	-1.0	6.7	0.0	-0.1	1.8	1.2	0.1	0.0	-1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





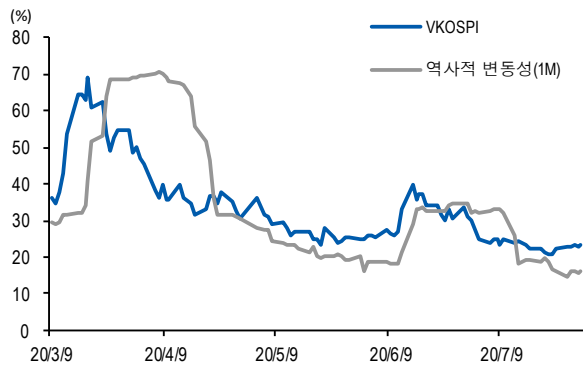
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	819,386	239.8	779,545	19.5%	지수옵션 전체	1,616,316	510.4	2,095,588
Put	796,930	270.7	1,316,043	21.0%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	23.57%(+0.66%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	1.14	-0.51	114,339	23,841	-18	19.5	Put	305.0(K+1)	7.79	1.34	2,427	1,724	333	18.8
	307.5(K+2)	1.64	-0.72	81,279	14,883	-470	19.4		302.5(K+0)	6.30	1.20	8,758	3,431	564	19.5
	305.0(K+1)	2.34	-0.91	49,096	20,020	398	19.5		300.0(K-1)	4.96	0.98	21,802	5,703	1,065	19.9
	302.5(K+0)	3.26	-1.13	29,308	15,667	358	19.7		297.5(K-2)	3.87	0.76	41,400	5,983	1,359	20.4
	300.0(K-1)	4.41	-1.37	11,624	22,276	-63	20.1		295.0(K-3)	3.02	0.59	70,836	9,349	673	21.2

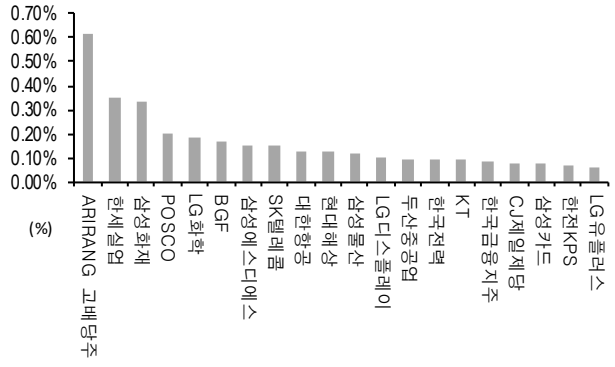
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,817,293	3,138.6	5,066,886	-128,569	-43,968	-22,826	66,440	-17.9	-5.4	24.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	57,900	-1.70	1,003.2	78.3	1,334,596	-70,053	-0.07%	8,446	-25,875	16,990	40,580	28,410
카카오	343,500	3.46	208.9	57.0	38,764	3,241	-0.09%	1,293	96	-1,814	305	-2,997
삼성전기	140,500	-2.77	46.7	56.2	18,979	-11,226	-0.34%	-253	-1,283	1,546	2,466	3,742
기아차	40,350	-0.49	40.9	56.1	60,283	-791	-0.10%	205	-2,215	2,020	689	1,530
삼성 SDI	398,000	3.65	207.4	55.1	21,469	1,359	-0.06%	18	867	-983	-315	-184
KT	23,850	0.00	9.2	54.8	60,894	2,407	0.09%	-738	3,414	-2,676	-1,604	-1,072
NAVER	301,500	2.38	252.0	53.7	55,237	2,958	0.05%	917	-988	491	-1,464	-589
현대차	126,500	-0.78	107.6	49.6	103,065	-4,102	-0.09%	-3,401	792	2,939	1,427	2,788
SK 텔레콤	221,500	0.68	74.1	45.7	35,645	6,970	0.15%	-1,106	2,734	-1,946	-1,669	-1,558
SK 하이닉스	82,800	-3.16	183.6	45.6	141,536	-9,353	-0.05%	-5,046	-1,548	6,509	8,337	14,147

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터