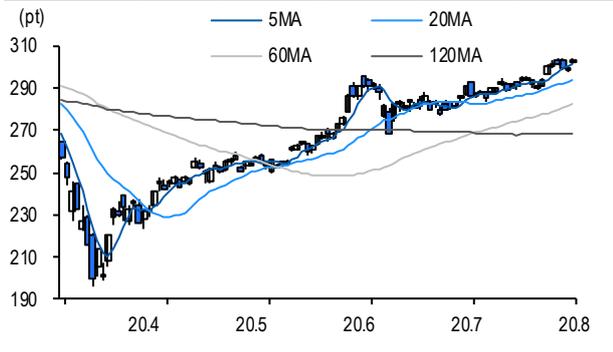


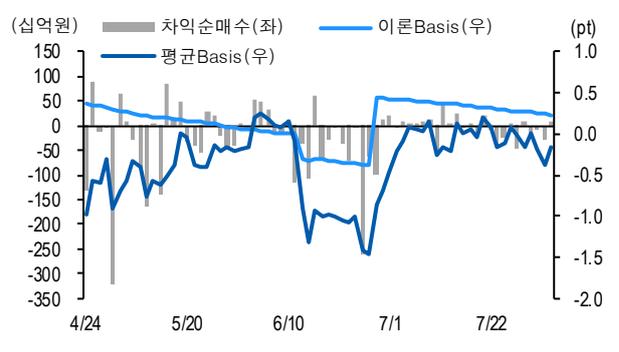


선물옵션시장 지표 2020.8.5

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	303.04	1.20	3.58	9,590.1	-	
선물 9월물	303.00	1.27	3.80	16,487.2	303,450	
선물 12월물	302.30	1.22	3.65	24.6	38,100	
8월물(mini)	302.94	1.26	3.76	1,513.4	75,385	
9월물(mini)	302.86	1.22	3.48	19.5	25,324	

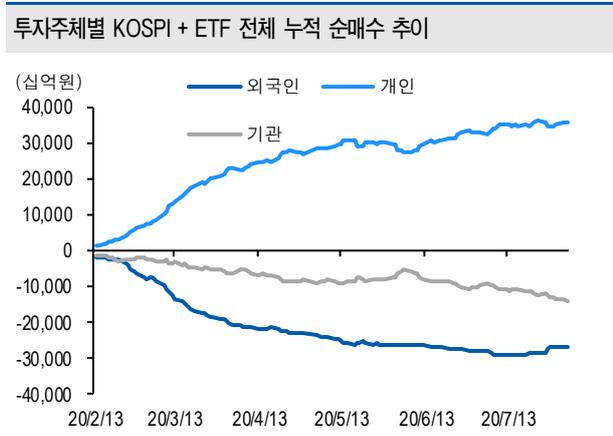


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.23	-0.17	-0.04	-0.13%	
베이스스(mini)	0.06	-0.20	-0.10	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.53	-0.50	-0.16%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.06	-0.20	-0.20	-0.08%	

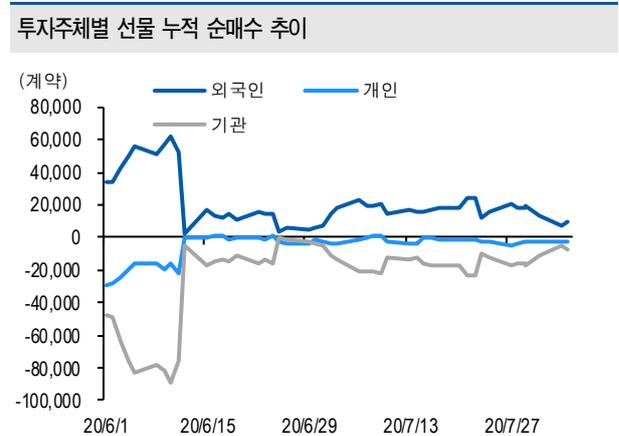


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-58.3	28.1	-30.2	0.0	-145.5	139.2	52.6	-2.2	-0.3	-0.2	
개인	184.5	-49.1	135.5	0.0	-1.7	27.5	-12.1	0.8	-0.6	-6.1	
기관	-148.9	25.8	-123.1	9.2	-136.1	-170.0	-40.6	1.2	0.9	7.7	
금융투자	38.9	135.6	174.5	-4.5	3.7	-324.4	-41.3	1.2	0.1	-3.8	
투신	-17.9	-8.7	-26.6	0.0	-22.2	172.0	0.7	0.0	0.0	8.4	
은행+보험+기타금융	-53.3	-53.9	-107.2	0.0	-18.9	-1.4	0.0	-0.1	0.8	0.0	
연기금+국가자차체	-114.2	-49.8	-164.0	13.7	-93.6	-16.2	0.0	0.0	0.0	3.1	
기타법인	22.7	-4.8	17.9	0.0	-0.1	3.3	0.1	0.2	0.0	-1.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	930,672	267.9	804,016	18.8%	지수옵션 전체	1,702,781	432.0	2,198,439
Put	772,109	164.2	1,394,423	21.8%	PCR(금액기준)	0.61	VKOSPI	22.42%(-1.10%p)

	Call				Put			
	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	내재변동성
Call	307.5(K+3)	1.99	0.70	89,936	16,783	-265	18.8	
	305.0(K+2)	2.87	0.97	70,940	19,961	96	18.6	
	302.5(K+1)	4.06	1.33	30,525	15,478	-633	18.8	
	300.0(K+0)	5.54	1.71	9,991	21,689	-947	19.0	
	297.5(K-1)	7.33	2.12	4,058	11,874	-115	19.7	
Put	302.5(K+1)	3.70	-2.33	15,340	5,345	1,806	20.0	
	300.0(K+0)	2.70	-1.93	29,657	8,872	2,542	20.4	
	297.5(K-1)	1.94	-1.56	41,324	7,981	1,549	21.0	
	295.0(K-2)	1.40	-1.26	61,842	14,014	3,807	21.7	
	292.5(K-3)	0.99	-1.04	52,738	12,270	3,501	22.4	

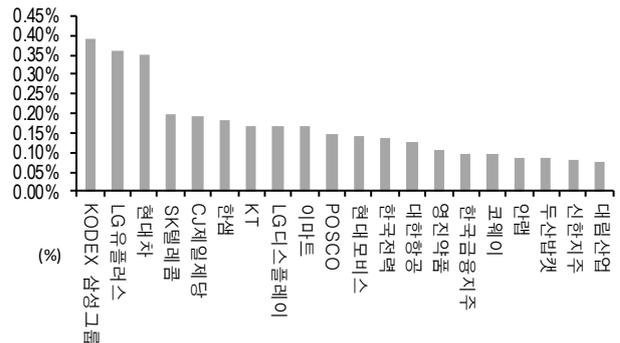
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,038,927	3,309.0	5,280,676	133,578	99,041	46,912	-150,527	-0.2	-6.1	7.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	57,300	0.88	798.6	71.7	1,332,110	-13,536	0.00%	820	6,087	-8,870	-26,270	15,774
삼성 SDI	416,000	0.60	159.7	68.9	20,916	-1,044	-0.01%	-1,515	-354	2,018	1,484	374
NAVER	311,000	-1.27	276.4	66.9	53,679	-270	0.02%	-893	-1,556	2,558	309	908
카카오	369,500	0.82	420.1	66.6	38,902	-3,324	-0.08%	-1,689	-1,911	3,943	1,876	4,056
기아차	41,100	3.27	51.8	63.6	92,789	16,233	0.05%	4,063	1,637	-5,712	-1,145	-11,508
LG 이노텍	165,000	1.54	17.7	55.6	19,954	-108	-0.63%	-699	51	641	687	-62
SK 텔레콤	226,000	2.96	94.0	54.4	47,076	7,523	0.20%	2,394	2,824	-5,184	-2,726	-4,324
코웨이	75,300	2.17	10.0	53.1	9,598	4,330	0.09%	80	795	-881	-3,307	-1,130
현대차	133,000	4.72	172.1	52.5	133,414	12,704	0.35%	267	1,971	-2,533	-3,344	-4,186
대림산업	87,000	4.57	34.3	48.4	19,206	3,611	0.07%	397	1,456	-1,836	476	-3,181

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

