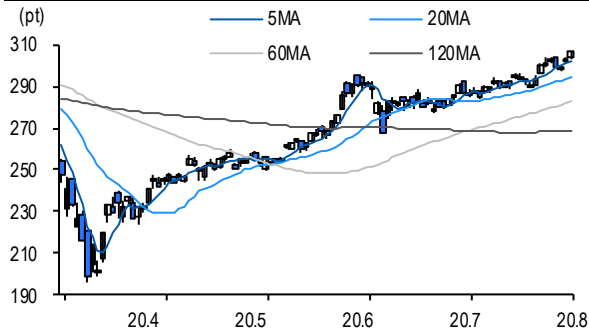
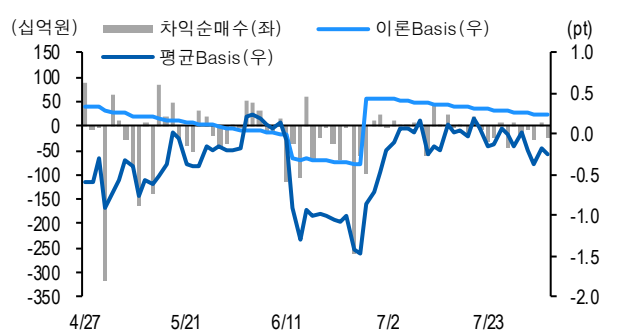


선물옵션시장 지표 2020.8.6

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	306.64	1.19	3.60	12,156.9	-
선물 9월물	306.70	1.22	3.70	17,786.6	308,160
선물 12월물	306.20	1.29	3.90	18.5	38,153
8월물(mini)	306.66	1.23	3.72	1,432.9	81,084
9월물(mini)	306.64	1.20	3.78	18.0	25,350

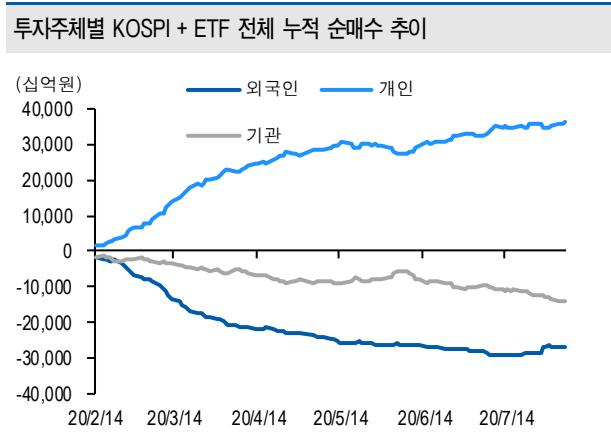


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.23	-0.25	0.06	-0.16%	
베이스스(mini)	0.05	-0.31	0.02	-0.12%	
제1스프레드(SP)	-0.05	-0.55	-0.55	-0.16%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	-0.07	-0.07	-0.04%	

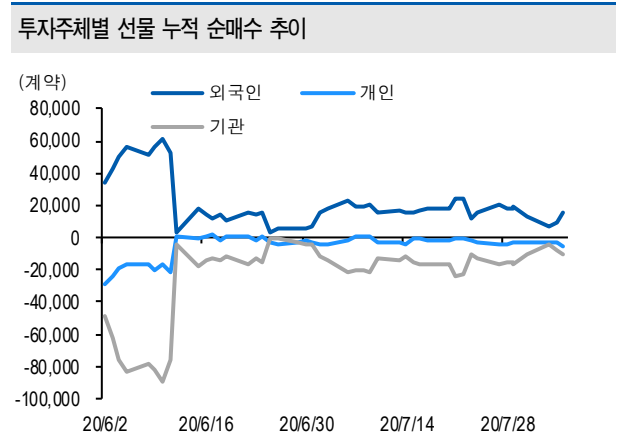


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-51.7	11.6	-40.1	1.5	-54.3	521.3	-64.7	0.3	-1.8	-44.8
개인	431.8	-29.9	401.9	0.0	1.2	-225.4	-28.2	0.9	0.3	35.7
기관	-366.6	18.9	-347.7	-28.2	-115.7	-300.5	93.5	-0.2	2.2	7.9
금융투자	-127.5	150.9	23.4	-9.1	-3.4	-747.2	92.8	0.4	2.8	-8.4
투신	-50.6	-25.8	-76.4	0.0	-19.2	382.1	0.7	-0.7	-0.2	7.3
은행+보험+기타금융	-48.9	-109.9	-158.8	-2.3	-15.6	28.2	0.0	0.0	-0.4	-0.3
연기금+국가자차체	-102.9	-5.7	-108.7	-16.8	-38.4	36.5	0.0	0.0	0.0	9.3
기타법인	-13.5	-0.6	-14.0	0.0	0.7	4.6	-0.5	-1.0	-0.7	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	926,867	263.2	814,470	18.2%	지수옵션 전체	1,704,134	430.3	2,241,891
Put	777,267	167.1	1,427,421	20.6%	PCR(금액기준)	0.63	VKOSPI	21.58%(-0.84%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	2.10	0.76	117,280	25,588	-2,519	18.2	Put	305.0(K+1)	2.84	-2.15	18,680	5,520	3,174	18.9
	307.5(K+2)	3.10	1.11	103,235	17,784	1,001	18.1		302.5(K+0)	1.97	-1.73	36,941	10,470	5,125	19.4
	305.0(K+1)	4.41	1.54	48,795	19,869	-92	18.2		300.0(K-1)	1.33	-1.37	72,570	14,946	6,074	19.8
	302.5(K+0)	6.04	1.98	15,213	16,378	900	18.6		297.5(K-2)	0.90	-1.04	66,843	11,745	3,764	20.5
	300.0(K-1)	7.92	2.38	6,490	21,185	-504	19.1		295.0(K-3)	0.63	-0.77	78,342	15,619	1,605	21.5

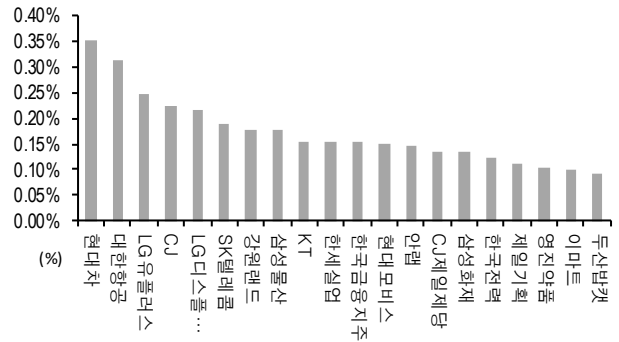
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,575,106	3,279.9	5,280,652	-24	-102,218	51,622	47,662	-44.8	35.7	7.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	466,000	12.02	460.2	77.8	22,370	1,454	-0.04%	2,265	-508	-2,128	783	-3,290
삼성전자	56,800	-0.87	670.8	66.8	1,261,706	-70,404	-0.16%	-25,105	2,865	21,413	7,891	27,930
현대차	135,000	1.50	141.7	57.1	139,537	6,123	0.35%	206	2,337	-2,007	30	-3,518
기아차	41,100	0.00	33.7	54.8	90,948	-1,841	0.02%	-1,752	1,022	730	-2,045	3,597
카카오	368,500	-0.27	215.0	54.4	39,241	339	-0.10%	358	21	-336	224	-75
KT	23,800	-0.21	11.8	50.4	74,549	7,267	0.16%	-3,954	9,557	-5,643	-8,669	3,026
SK 텔레콤	227,000	0.44	71.4	50.1	49,867	2,791	0.19%	-2,221	2,257	165	-1,259	197
NAVER	313,500	0.80	121.5	48.4	49,294	-4,385	0.06%	-1,577	-1,630	3,096	429	2,902
LG 화학	669,000	4.21	256.7	42.2	29,424	-1,237	-0.19%	-1,833	1,174	747	1,565	94
LG 전자	78,200	0.13	38.9	41.7	20,497	-2,383	-0.09%	-2,798	535	2,313	1,816	1,800

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터