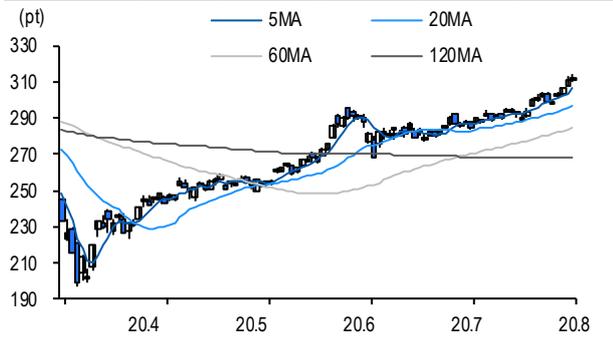
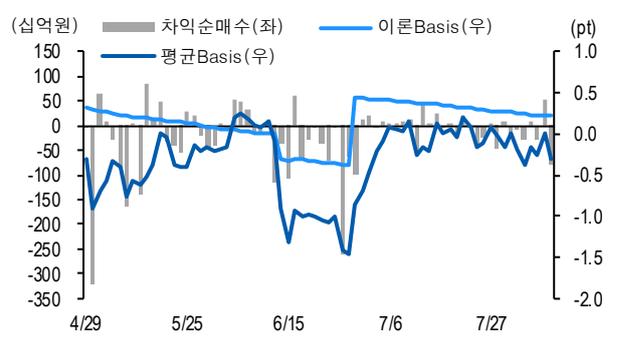


선물옵션시장 지표 2020.8.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.57	0.40	1.25	12,530.8	-
선물 9월물	312.10	0.18	0.55	23,015.5	309,218
선물 12월물	311.60	0.19	0.60	32.5	37,487
8월물(mini)	312.04	0.19	0.60	2,015.4	89,136
9월물(mini)	312.00	0.14	0.52	76.2	27,394

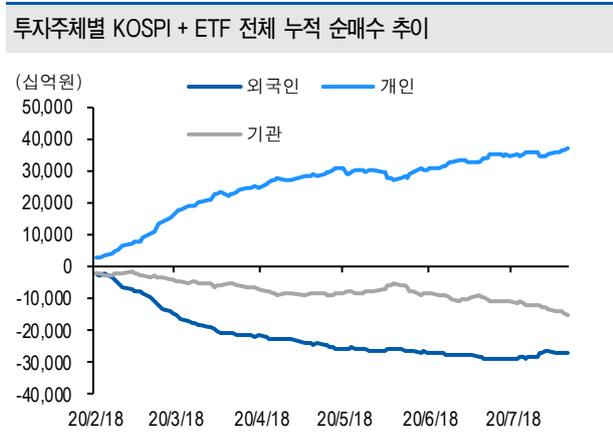


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.22	-0.31	-0.47	-0.17%	
베이스스(mini)	0.04	-0.32	-0.53	-0.11%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.55	-0.55	-0.16%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	-0.53	-0.53	-0.18%	

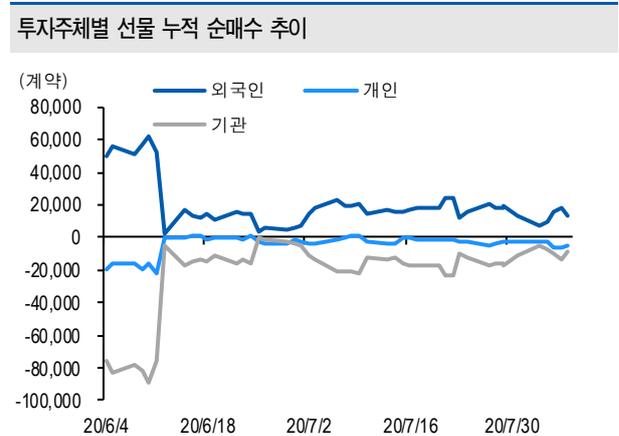


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-73.8	-0.6	-74.4	0.0	-155.7	-110.1	-300.9	4.9	-0.9	-36.0
개인	853.6	25.4	879.0	0.0	-0.8	26.8	1.7	3.0	1.3	-26.0
기관	-799.1	-23.2	-822.3	-79.4	-132.0	63.1	299.3	-8.8	-0.2	59.7
금융투자	-413.9	15.1	-398.8	-18.6	-26.8	-56.9	299.2	-9.0	-0.3	17.1
투신	-80.7	-20.4	-101.1	0.0	-26.8	22.5	0.1	0.1	0.1	-6.1
은행+보험+기타금융	-70.6	-30.2	-100.8	0.0	-28.0	37.4	0.0	0.0	0.0	14.7
연기금+국가지자체	-183.3	8.1	-175.1	-60.7	-47.9	60.1	0.0	0.0	0.0	34.0
기타법인	19.4	-1.6	17.7	0.0	-1.4	20.2	-0.1	0.9	-0.2	2.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,570,918	385.6	868,543	17.2%	지수옵션 전체	2,999,298	712.8	2,432,131
Put	1,428,380	327.2	1,563,588	21.4%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	22.07%(+0.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	0.67	-0.15	244,870	26,451	3,066	17.4	Put	315.0(K+1)	4.87	-0.85	7,067	1,430	952	20.5
	317.5(K+2)	1.16	-0.14	193,620	23,955	3,817	17.2		312.5(K+0)	3.44	-0.65	33,691	3,706	1,945	20.3
	315.0(K+1)	1.91	-0.07	187,877	22,721	-113	17.0		310.0(K-1)	2.36	-0.54	100,866	11,713	3,333	20.4
	312.5(K+0)	2.98	0.00	91,906	17,246	1,502	16.9		307.5(K-2)	1.59	-0.42	143,609	13,569	4,210	20.9
	310.0(K-1)	4.40	0.12	32,007	24,756	-693	16.9		305.0(K-3)	1.09	-0.29	168,707	18,655	6,837	21.8

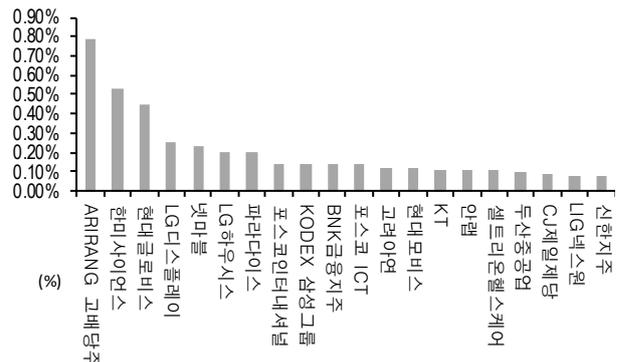
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,117,086	4,474.3	5,443,195	99,420	-40,462	-40,251	75,680	-36.0	-26.0	59.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	57,600	-0.52	997.6	94.9	1,075,485	-87,431	-0.10%	-7,922	1,537	2,586	18,895	-11,304
삼성 SDI	485,000	3.19	475.4	82.0	22,892	1,152	-0.05%	-510	-694	1,240	-261	1,862
기아차	42,500	0.35	62.7	65.9	73,282	-5,004	-0.02%	1,199	577	-1,791	-3,041	2,574
NAVER	314,500	-2.48	204.2	60.5	46,825	-460	0.05%	-53	-1,161	1,145	-1,178	1,049
LG 전자	76,900	-0.52	34.5	58.7	21,290	620	-0.06%	250	619	-793	195	-540
KODEX 삼성그룹	7,670	-1.03	1.6	54.4	418	74	0.14%	0	1	-1	-1	0
현대차	147,000	1.38	253.3	53.7	140,012	-4,501	-0.03%	176	357	-458	619	819
S-Oil	62,300	0.65	21.1	50.4	18,569	314	-0.03%	1,014	496	-1,533	-11	-1,522
한국금융지주	60,300	5.05	15.7	45.1	57,137	1,336	0.01%	-1,500	-853	2,353	3,660	-686
삼성전기	141,000	-0.70	32.7	43.8	20,910	-397	0.02%	-2,304	1,219	1,079	453	396

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

