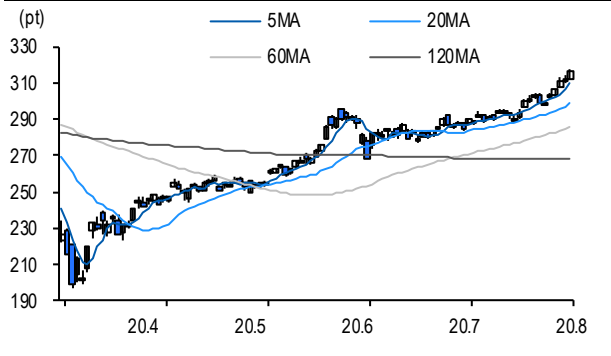


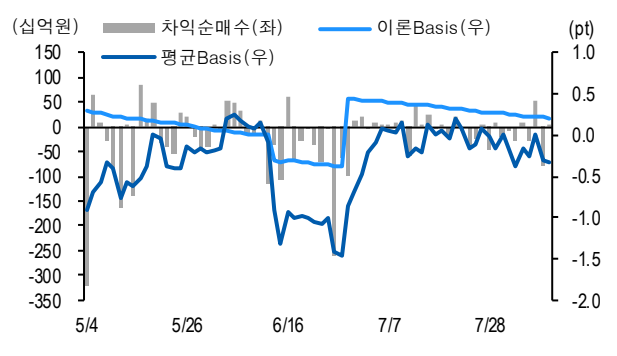


선물옵션시장 지표 2020.8.11

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.77	1.34	4.20	13,452.3	-
선물 9월물	316.95	1.55	4.85	21,373.3	308,630
선물 12월물	316.65	1.62	5.05	30.4	37,588
8월물(mini)	316.92	1.56	4.88	1,844.3	93,993
9월물(mini)	316.90	1.54	4.90	140.7	31,731

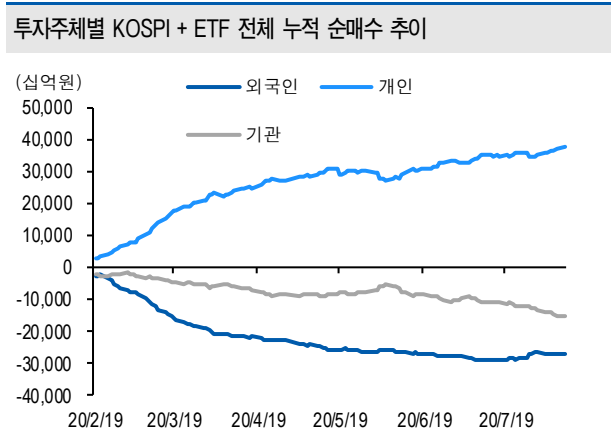


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.20	-0.33	0.18	-0.17%
베이스스(mini)	0.02	-0.38	0.15	-0.13%
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.51	-0.45	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	0.12	0.12	0.03%

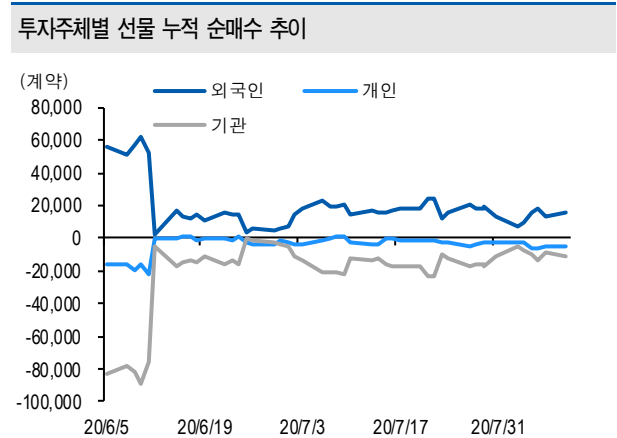


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-128.6	9.4	-119.2	0.0	59.7	150.0	42.1	1.8	-0.2	8.4
개인	352.8	-0.1	352.7	0.0	-2.3	-16.3	0.7	-0.2	2.4	26.5
기관	-231.2	-7.2	-238.5	2.4	-255.7	-105.5	-41.9	-0.8	-1.8	-36.1
금융투자	16.8	55.3	72.1	-62.7	-19.6	-516.8	-41.3	-2.4	-1.3	-21.6
투신	-71.6	-47.6	-119.3	0.0	-41.8	444.9	-0.6	1.6	-0.5	23.5
은행+보험+기타금융	-96.9	-43.6	-140.5	0.0	-43.9	33.0	0.0	0.1	0.0	3.9
연기금+국가자재	-43.0	-11.0	-54.0	65.1	-121.0	-66.6	0.0	0.0	0.0	-41.9
기타법인	7.1	-2.1	5.0	0.0	0.0	-28.2	-0.9	-0.9	-0.3	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,907,115	518.3	887,433	21.7%	지수옵션 전체	3,234,931	774.1	2,487,657
Put	1,327,816	255.8	1,600,224	24.1%	PCR(금액기준)	0.49	VKOSPI	22.94%(+0.87%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.53	0.86	263,230	24,371	-2,080	21.4	Put	315.0(K+1)	2.01	-2.86	52,955	7,991	6,561	21.4
	317.5(K+2)	2.53	1.37	220,219	20,573	-3,382	21.7		312.5(K+0)	1.23	-2.21	106,291	9,582	5,876	21.9
	315.0(K+1)	3.88	1.97	178,058	22,138	-583	21.9		310.0(K-1)	0.75	-1.61	143,538	18,126	6,413	22.9
	312.5(K+0)	5.62	2.64	79,336	19,755	2,509	22.8		307.5(K-2)	0.46	-1.13	151,124	17,212	3,643	24.1
	310.0(K-1)	7.64	3.24	18,612	24,851	95	24.0		305.0(K-3)	0.30	-0.79	172,566	24,051	5,396	25.7

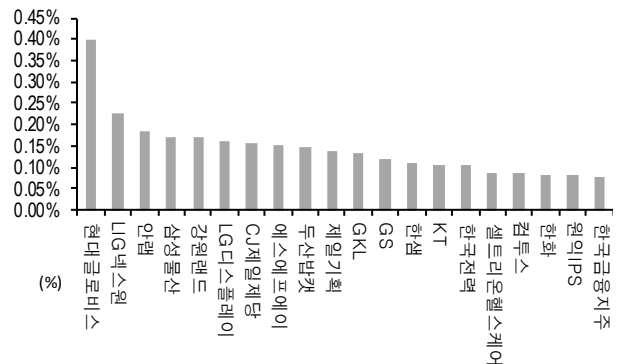
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,643,921	4,796.3	5,646,483	203,288	63,339	109,312	-177,445	8.4	26.5	-36.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	58,000	0.69	713.4	71.3	1,043,974	-31,511	-0.03%	16,302	23,600	-43,672	-6,596	-35,055
NAVER	313,500	-0.32	200.4	67.5	47,627	802	0.03%	936	352	-1,351	-2,005	42
기아차	46,300	8.94	200.4	65.5	52,168	-21,114	-0.05%	-5,006	-1,343	6,348	9,224	6,626
LG 전자	86,200	12.09	189.7	61.9	40,869	19,579	0.03%	4,689	658	-5,461	-1,146	-15,111
대림산업	86,200	0.00	13.4	60.6	14,179	-3,602	0.06%	1,127	851	-1,985	-2,633	635
삼성 SDI	473,500	-2.37	237.5	60.0	19,553	-3,339	-0.03%	-208	447	259	30	591
현대차	169,500	15.31	772.1	56.2	129,928	-10,084	-0.04%	5,969	-11,203	5,151	956	4,545
GS 건설	26,900	0.94	8.3	49.3	39,931	-5,023	-0.07%	2,122	-2,180	58	-917	947
하나금융지주	30,200	3.25	28.3	45.9	95,703	-38,880	0.04%	2,396	21,353	-24,799	-12,281	-9,241
SK 텔레콤	238,500	4.15	86.9	45.3	39,286	-1,965	-0.01%	-824	-238	966	-192	639

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터