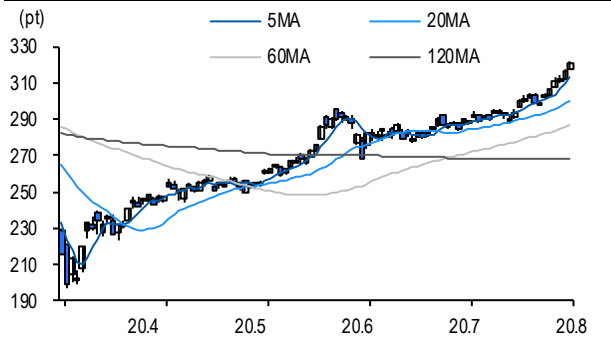


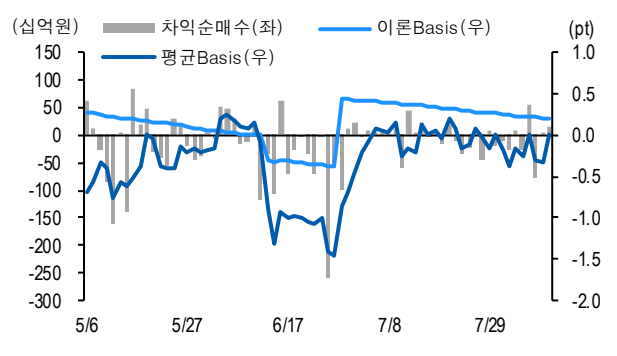


선물옵션시장 지표 2020.8.12

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	321.02	1.34	4.25	14,078.0	-
선물 9월물	320.80	1.21	3.85	25,852.8	304,956
선물 12월물	320.30	1.15	3.65	29.2	37,144
8월물(mini)	320.82	1.23	3.90	2,112.5	103,721
9월물(mini)	320.80	1.21	3.90	425.8	33,170

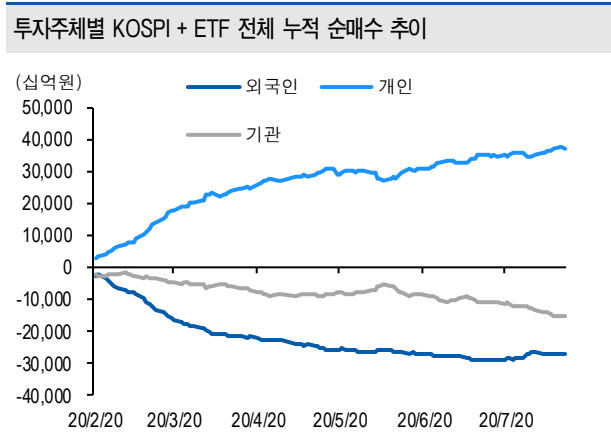


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.19	0.00	-0.22	-0.06%
베이스스(mini)	0.01	-0.05	-0.20	-0.02%
제1스프레드(SP)	-0.05	-0.52	-0.55	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.23	-0.23	-0.08%

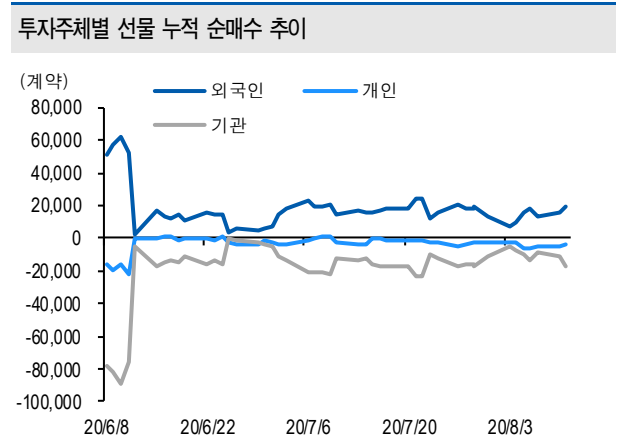


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	146.6	12.0	158.6	0.0	141.8	99.2	233.5	-26.0	-1.6	9.0
개인	-174.5	-23.4	-197.9	0.0	0.6	173.8	13.2	6.6	1.6	28.3
기관	39.7	11.0	50.7	15.9	-287.9	-257.1	-245.5	16.8	0.3	-38.6
금융투자	382.8	209.9	592.7	-1.6	-19.2	-240.9	-246.0	-4.8	0.2	-70.1
투신	-90.7	-83.9	-174.6	0.0	-69.0	-48.1	0.5	21.6	-0.2	8.6
은행+보험+기타금융	-84.1	-113.5	-197.6	-0.4	-74.8	53.2	0.0	0.0	0.4	3.7
연기금+국가자차체	-129.2	-4.0	-133.3	17.9	-103.2	-21.4	0.0	0.0	0.0	19.1
기타법인	-11.8	0.4	-11.4	0.0	0.1	-15.9	-1.2	2.6	-0.4	1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

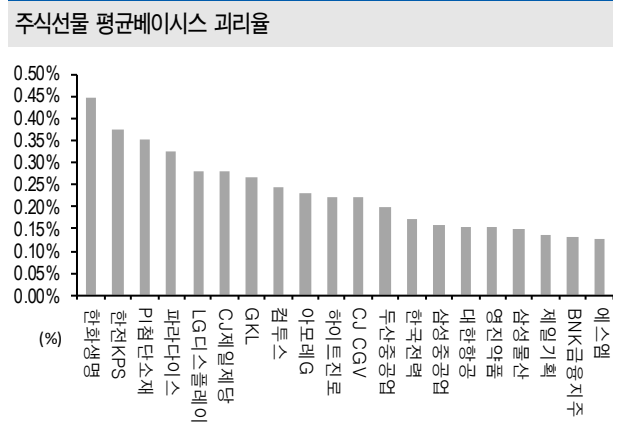
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,473,573	718.8	894,337	20.1%	지수옵션 전체	4,000,633	1,005.7	2,567,692
Put	1,527,060	287.0	1,673,355	23.7%	PCR(금액기준)	0.40	VKOSPI	22.98%(+0.04%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.91	0.40	348,675	21,427	-97	20.4	Put	320.0(K+1)	2.01	-2.63	121,531	16,329	15,537	21.5
	322.5(K+2)	1.64	0.75	267,234	22,296	1,918	19.7		317.5(K+0)	1.13	-2.00	180,659	14,254	11,685	21.8
	320.0(K+1)	2.81	1.28	229,338	20,622	-3,749	19.4		315.0(K-1)	0.65	-1.36	191,530	13,430	5,439	23.0
	317.5(K+0)	4.42	1.89	84,935	18,036	-2,537	19.2		312.5(K-2)	0.35	-0.88	170,234	18,718	9,136	23.9
	315.0(K-1)	6.44	2.56	31,853	20,620	-1,518	19.4		310.0(K-3)	0.22	-0.53	161,391	22,337	4,211	25.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	6,507,091	4,856.1	6,008,346	361,863	-18,008	60,533	-44,157	9.0	28.3	-38.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	475,000	0.32	298.0	67.5	19,215	-338	0.01%	1,462	-229	-1,233	161	-1,495
삼성전자	58,400	0.69	957.2	65.7	904,451	-139,523	0.04%	15,837	7,837	-23,500	-41,138	14,526
LG 이노텍	159,500	0.63	20.1	64.5	16,152	-1,846	-0.07%	1,417	324	-1,741	-868	-247
기아차	46,900	1.30	106.1	61.7	48,392	-3,776	-0.15%	-1,151	-265	1,409	342	1,365
NAVER	311,500	-0.64	123.3	59.7	45,101	-2,526	0.11%	-901	165	704	-549	-653
GS 건설	27,950	3.90	22.8	57.8	22,602	-17,329	-0.09%	4,088	-3,848	-240	-880	640
하나금융지주	31,300	3.64	49.6	50.9	83,265	-12,438	0.10%	-322	-9,826	9,809	-421	-3,508
한국금융지주	64,800	-3.43	28.3	50.9	34,237	-20,838	0.01%	-1,055	413	742	1,400	7,551
현대차	179,000	5.60	569.5	49.5	111,889	-18,039	0.05%	-2,362	1,148	995	-8,309	11,961
대림산업	87,300	1.28	14.7	48.7	14,620	441	0.03%	1,971	787	-2,758	-2,523	-249

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터