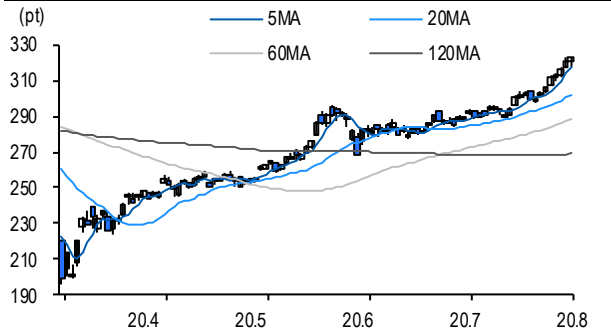


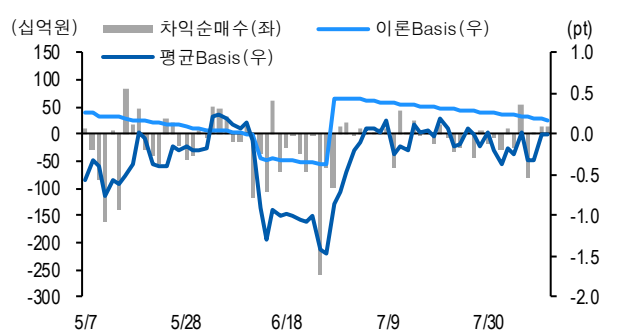


선물옵션시장 지표 2020.8.13

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.68	0.52	1.66	12,618.0	-
선물 9월물	322.50	0.53	1.70	26,253.2	304,157
선물 12월물	322.00	0.53	1.70	22.0	37,125
8월물(mini)	322.56	0.54	1.74	2,009.5	98,840
9월물(mini)	322.44	0.51	1.64	362.1	38,590

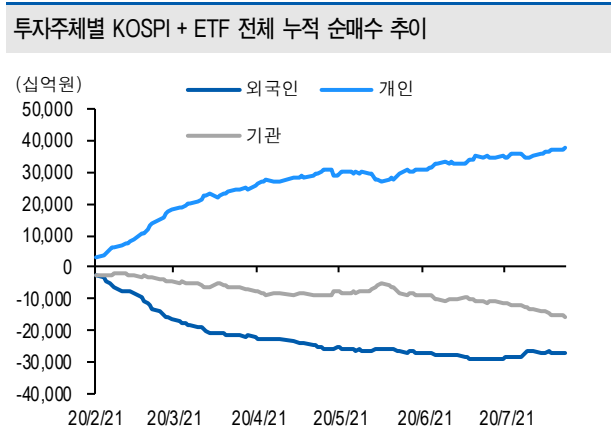


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.18	-0.01	-0.18	-0.06%
베이스스(mini)	0.01	-0.01	-0.12	-0.01%
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.51	-0.50	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.12	-0.12	-0.04%

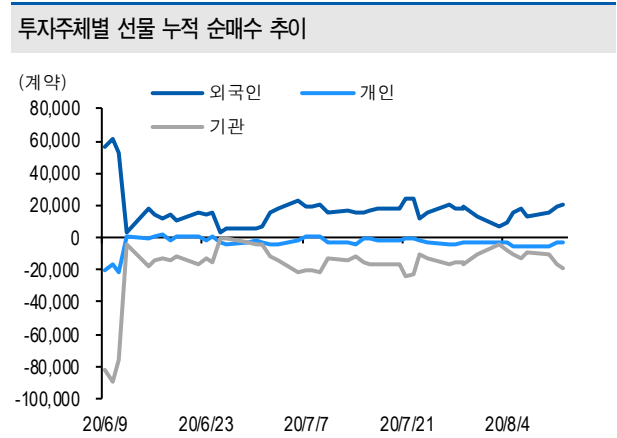


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-173.2	10.2	-163.0	0.0	-97.2	108.5	-1.2	-2.9	2.6	11.0
개인	353.4	41.7	395.2	0.0	-0.2	33.4	4.6	-7.5	-3.3	-13.5
기관	-202.9	-45.4	-248.2	13.0	-60.7	-148.7	-3.1	12.0	1.4	4.5
금융투자	-40.8	-12.0	-52.8	0.0	-13.5	16.0	-3.1	1.2	1.4	-22.3
투신	-55.9	-68.7	-124.6	0.0	-22.1	-119.1	0.0	10.3	-0.1	-17.6
은행+보험+기타금융	4.1	48.0	52.1	0.0	-18.1	-27.7	0.0	0.5	0.1	1.8
연기금+국가자차체	-88.9	5.0	-83.9	13.0	-24.2	-17.8	0.0	0.0	0.0	42.6
기타법인	22.6	-6.5	16.1	0.0	-0.2	6.8	-0.4	-1.6	-0.7	-2.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

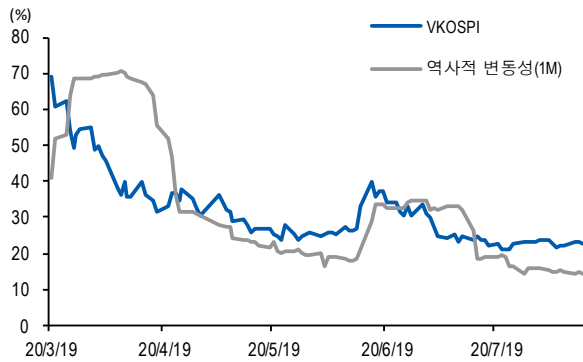
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	1,904,767	421.6	970,371	17.1%	지수옵션 전체	3,724,054	741.7	2,716,632		
Put	1,819,287	320.1	1,746,261	21.2%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	22.86%(-0.12%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	0.28	-0.20	326,336	27,602	7,825	17.8	Put	322.5(K+1)	1.67	-1.68	51,981	10,035	3,705	18.5
	325.0(K+2)	0.76	-0.15	352,630	30,277	8,850	17.4		320.0(K+0)	0.74	-1.27	187,768	15,931	-398	18.7
	322.5(K+1)	1.73	0.09	308,400	26,802	4,506	17.1		317.5(K-1)	0.28	-0.85	292,656	17,114	2,860	19.0
	320.0(K+0)	3.30	0.49	252,806	29,661	9,039	16.9		315.0(K-2)	0.13	-0.52	295,059	21,536	8,106	21.0
	317.5(K-1)	5.25	0.83	79,855	21,154	3,118	13.0		312.5(K-3)	0.06	-0.29	258,177	23,343	4,625	22.9

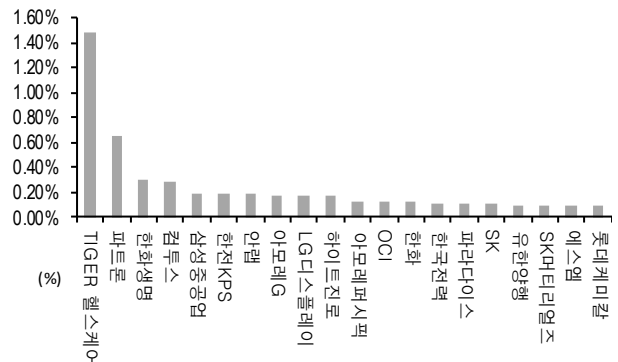
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,604,447	4,895.2	6,018,555	10,209	933	-12,347	15,693	11.0	-13.5	4.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	475,500	0.11	261.7	79.8	17,806	-1,409	0.04%	-53	70	-14	144	-548
삼성전자	59,000	1.03	821.7	78.1	604,076	-300,375	-0.06%	-8,793	-4,405	17,162	-9,203	31,085
LG 이노텍	161,000	0.94	20.3	66.7	10,909	-5,243	-0.57%	434	-59	-376	-700	619
하나금융지주	31,800	1.60	51.4	61.5	49,204	-34,061	-0.09%	-777	-3,546	3,983	13,180	16,864
기아차	45,250	-3.52	75.3	60.3	45,155	-3,237	-0.09%	345	-292	-35	3,833	-2,534
LG 전자	87,200	5.19	131.4	57.0	41,410	4,868	0.07%	-718	-2,595	1,888	2,765	-7,584
카카오	353,500	0.86	144.7	56.8	19,264	-9,277	-0.31%	-72	-1,986	2,050	2,463	-528
NAVER	305,500	-1.93	139.9	53.5	34,414	-10,687	0.07%	1,032	453	-1,470	-4,733	3,240
현대차	172,500	-3.63	442.1	52.2	75,033	-36,856	0.01%	2,400	-636	-1,649	-3,573	6,362
LG 생활건강	1,549,000	-1.34	27.9	51.1	439	-115	0.00%	26	22	-48	-131	67

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터