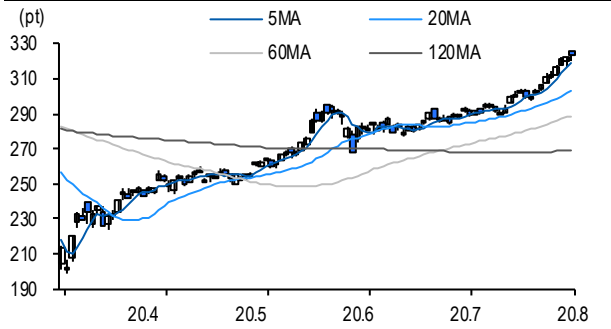


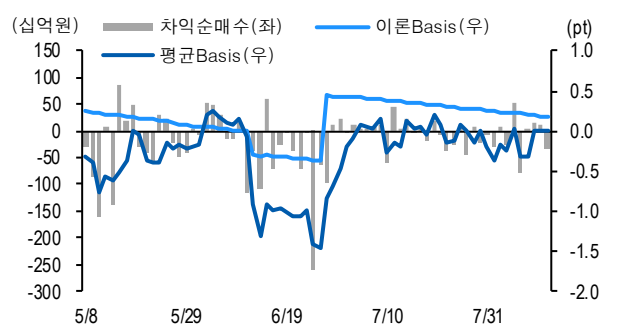


선물옵션시장 지표 2020.8.14

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.33	0.20	0.65	13,500.8	-
선물 9월물	323.10	0.19	0.60	28,443.3	294,842
선물 12월물	322.65	0.20	0.65	44.5	37,443
8월물(mini)	321.04	-0.47	-1.52	1,587.9	0
9월물(mini)	322.90	0.12	0.46	1,274.8	62,039

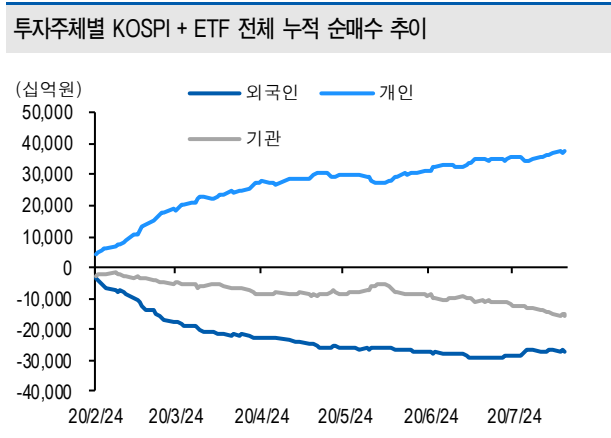


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.17	0.00	-0.23	-0.05%
베이스(mini)	0.00	0.07	-2.29	0.02%
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.50	-0.45	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-2.45	-2.45	-0.76%

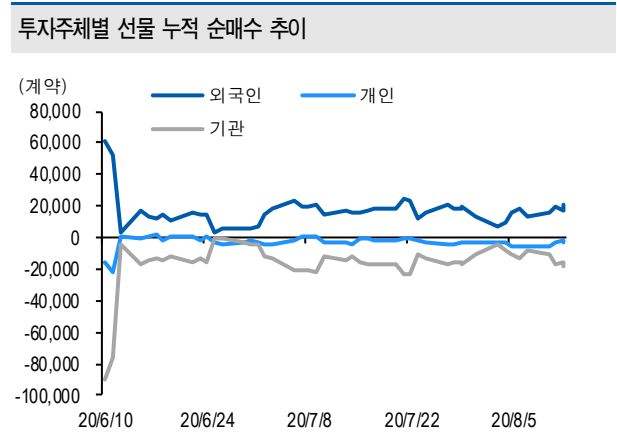


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-351.0	-7.6	-358.6	2.0	-272.5	-287.8	-22.5	-14.8	-3.5	-4.3
개인	155.3	-53.5	101.8	0.0	9.8	112.7	-2.9	-3.8	1.4	38.8
기관	186.4	63.5	249.9	-33.8	301.8	178.0	25.0	18.9	2.3	-34.6
금융투자	480.8	221.5	702.3	0.0	518.9	403.7	25.6	-1.9	2.5	13.8
투신	-158.0	-19.1	-177.1	0.0	-145.8	-175.2	-0.5	16.9	0.5	10.2
은행+보험+기타금융	9.8	-128.9	-119.1	0.0	-9.1	-63.4	0.0	4.7	0.0	-0.7
연기금+국가자재	-131.6	-8.7	-140.4	-33.8	-41.1	12.9	0.0	-0.8	-0.8	-57.9
기타법인	9.3	-2.4	6.9	0.0	-1.2	-2.9	0.3	-0.4	-0.2	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





**선물옵션시장 지표**

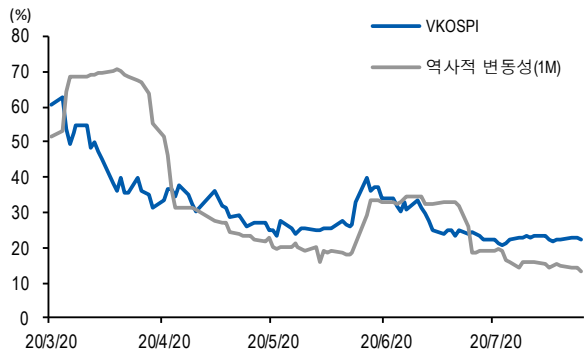
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,374,485	526.4	512,203	11.1%	지수옵션 전체	4,552,596	863.7	1,374,592
Put	2,178,111	337.3	862,389	30.8%	PCR(금액기준)	0.64	VKOSPI	22.12%(-0.74%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	0.01	-0.08	482,948	0	-24,558	16.8	Put	325.0(K+1)	4.04	0.81	409,509	0	-2,018	46.4
	327.5(K+2)	0.01	-0.27	586,480	0	-27,602	11.2		322.5(K+0)	1.76	0.09	568,553	0	-10,035	31.9
	325.0(K+1)	0.02	-0.74	604,914	0	-30,277	5.9		320.0(K-1)	0.31	-0.43	503,835	0	-15,931	20.6
	322.5(K+0)	0.14	-1.59	241,285	0	-26,802	7.4		317.5(K-2)	0.03	-0.25	176,925	0	-17,114	17.9
	320.0(K-1)	1.30	-2.00	50,154	0	-29,661	5.8		315.0(K-3)	0.01	-0.12	81,990	0	-21,536	20.9

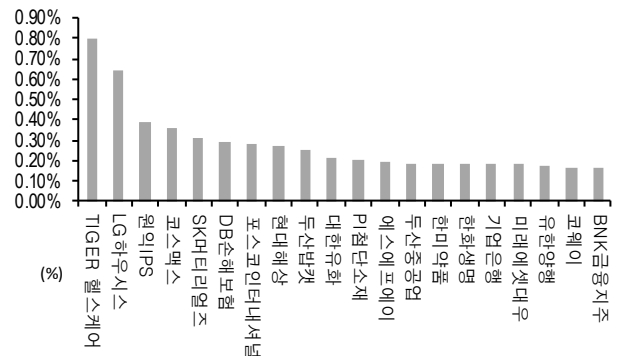
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

**역사적 변동성과 VKOSPI**



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

**주식선물 평균베이스스 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	5,825,314	4,984.4	4,709,172	-1,309,383	-37,089	113,222	-75,723	-4.3	38.8	-34.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한샘	101,500	-0.98	5.3	37.4	0	-4,580	-0.22%	-145	147	-2	226	249
삼성 SDI	472,500	-0.63	99.1	29.8	0	-17,806	0.01%	-305	1,125	-1,018	287	183
기아차	44,400	-1.88	30.1	29.8	0	-45,155	-0.13%	1,992	1,156	-3,143	127	2,999
현대글로비스	122,000	-2.79	7.1	26.0	0	-6,578	-0.20%	104	247	-347	-790	642
삼성전자	58,100	-1.53	324.7	25.4	0	-604,076	-0.16%	18,103	-17,698	-185	33,353	-18,084
현대차	168,000	-2.61	159.7	23.4	0	-75,033	-0.14%	692	8,197	-8,657	-5,166	-811
SK 이노베이션	183,000	0.00	39.4	22.7	0	-26,618	-0.01%	-3,031	515	2,507	3,180	-1,871
대림산업	86,300	-1.48	6.3	22.5	0	-12,797	-0.13%	-662	-242	904	1,163	218
카카오	359,500	1.70	86.2	21.4	0	-19,264	0.03%	-670	-357	1,032	373	-6,655
NAVER	304,500	-0.33	91.2	21.3	0	-34,414	-0.11%	99	1,189	-1,302	6,848	-1,940

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

