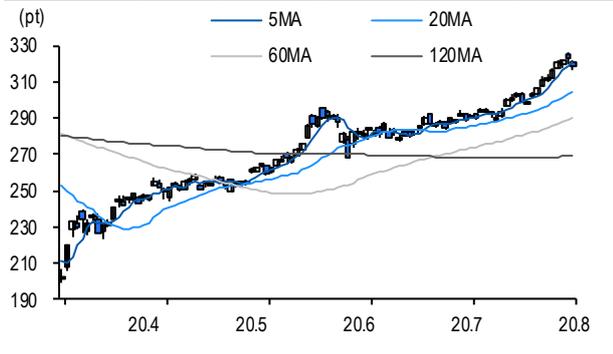


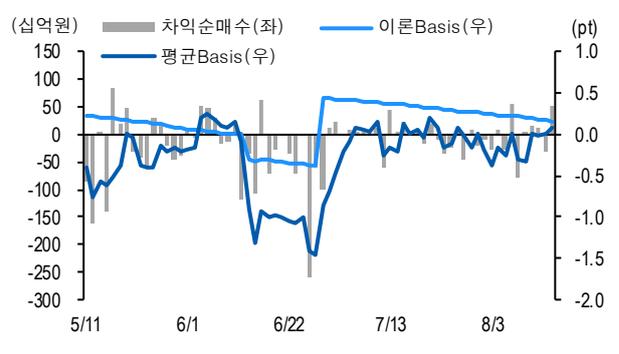


선물옵션시장 지표 2020.8.18

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.24	-1.26	-4.09	11,742.9	-
선물 9월물	318.75	-1.35	-4.35	22,576.7	293,159
선물 12월물	318.25	-1.36	-4.40	86.0	37,154
9월물(mini)	318.76	-1.34	-4.14	2,556.3	66,687
10월물(mini)	318.34	-1.14	-3.66	13.5	401

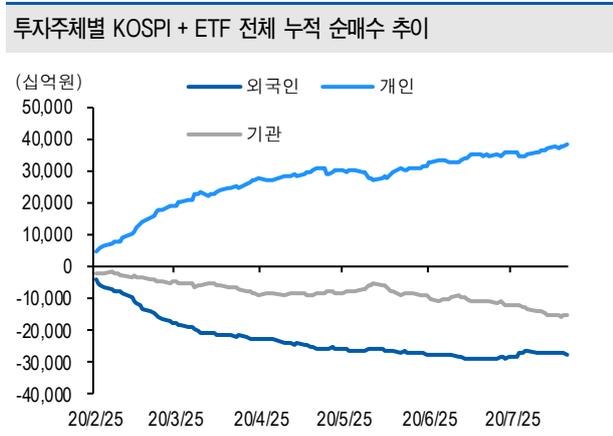


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.15	0.09	-0.49	-0.02%	
베이스스(mini)	0.15	0.08	-0.48	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-0.11	-0.49	-0.50	-0.12%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	-0.52	-0.52	-0.21%	

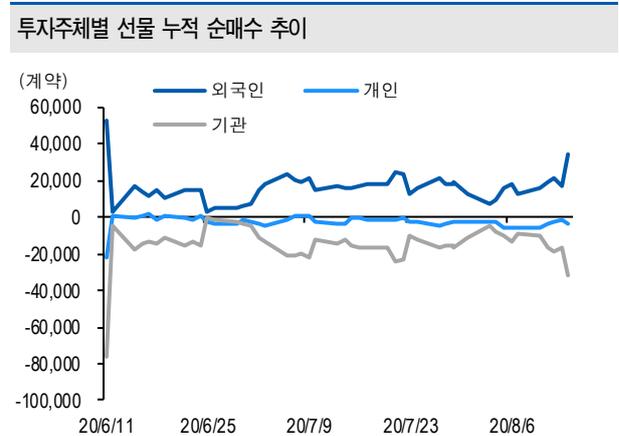


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-462.2	-3.7	-465.9	21.4	-191.5	335.5	333.4	-6.1	3.8	51.4
개인	596.7	62.2	658.9	0.0	-0.8	-268.9	17.0	2.2	-1.1	2.2
기관	-124.4	-58.0	-182.5	30.8	-131.6	-45.4	-350.2	3.8	-2.5	-54.2
금융투자	280.0	-44.3	235.7	1.6	8.4	230.8	-349.8	4.3	0.1	-1.4
투신	-124.6	-20.6	-145.2	1.6	-46.0	-261.4	-0.3	-1.5	-2.4	-74.4
은행+보험+기타금융	-22.3	12.1	-10.1	0.0	-11.0	9.4	0.0	1.0	-0.2	5.7
연기금+국가자재	-184.6	7.6	-177.0	27.6	-68.7	-24.2	0.0	0.0	0.0	16.0
기타법인	-10.1	-0.5	-10.6	0.0	-1.5	-21.2	-0.2	0.1	-0.3	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	633,387	265.8	566,437	18.0%	지수옵션 전체	1,403,050	588.8	1,507,607
Put	769,663	323.0	941,170	20.3%	PCR(금액기준)	1.22	VKOSPI	22.58%(+0.46%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	2.50	-1.32	50,165	9,976	3,343	18.0	Put	325.0(K+1)	10.15	2.40	2,387	1,423	214	19.7
	327.5(K+2)	3.17	-1.57	46,079	5,110	2,180	18.0		322.5(K+0)	8.68	2.14	4,482	2,407	855	19.8
	325.0(K+1)	3.96	-1.88	26,286	10,475	947	17.9		320.0(K-1)	7.32	1.89	8,575	3,623	749	19.9
	322.5(K+0)	4.90	-2.26	15,344	8,471	2,607	17.8		317.5(K-2)	6.18	1.61	9,606	3,807	204	20.2
	320.0(K-1)	6.07	-2.47	7,204	11,080	-255	18.0		315.0(K-3)	5.16	1.34	21,892	5,540	557	20.4

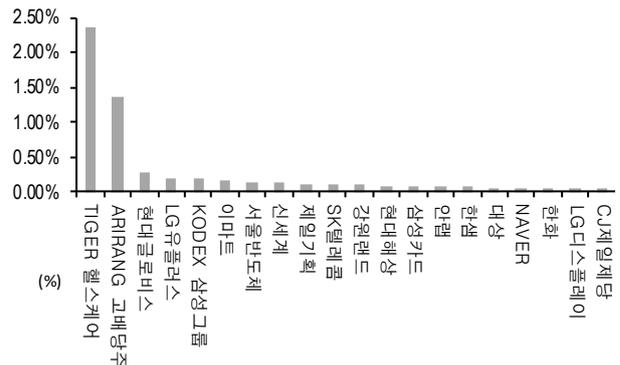
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,145,471	3,844.0	4,870,727	161,555	38,690	63,957	-103,698	51.4	2.2	-54.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 텔레콤	237,000	-2.67	114.9	91.7	38,061	7,183	0.09%	134	5,139	-5,313	-785	-5,346
LG 전자	88,700	1.49	134.3	91.4	51,587	1,331	-0.02%	879	-322	-612	-5,954	4,365
기아차	44,450	-0.67	58.8	85.9	56,548	7,339	-0.21%	5,825	2,926	-8,751	-1,757	-5,779
현대차	167,000	-1.18	552.2	75.3	109,895	-11,828	0.00%	1,289	-2,378	1,085	-723	8,354
대림산업	87,300	0.69	10.6	71.6	19,173	1,691	0.00%	118	1,089	-1,205	-361	-820
삼성전자	58,300	-0.68	621.4	68.6	1,197,524	-21,813	-0.02%	22,631	-27,089	1,830	-915	16,468
현대모비스	223,500	-2.19	62.3	60.6	11,844	-1,777	0.00%	1,608	-345	-1,275	1,502	-251
NAVER	306,000	-0.49	110.1	59.6	38,894	-2,199	0.05%	654	150	-807	-2,702	1,876
GS 건설	27,650	0.18	8.3	57.6	45,089	3,218	-0.07%	1,337	768	-2,105	-734	-1,453
한국금융지주	63,600	1.76	21.6	55.3	48,691	405	0.01%	-2,059	2,769	-710	441	-1,622

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터