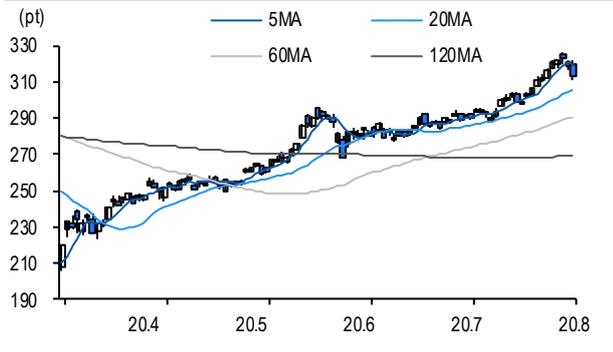


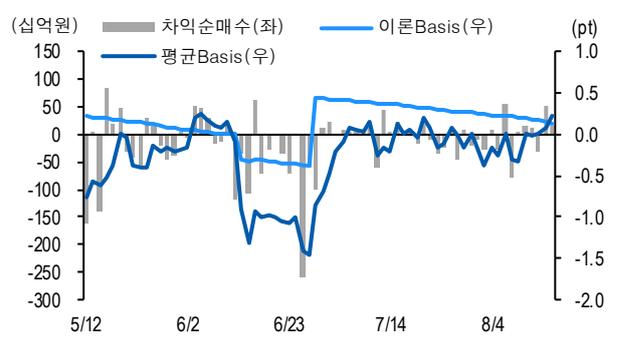


선물옵션시장 지표 2020.8.19

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.84	-2.00	-6.40	12,476.9	-
선물 9월물	313.05	-1.79	-5.70	23,858.5	297,008
선물 12월물	312.60	-1.78	-5.65	83.5	37,397
9월물(mini)	313.08	-1.78	-5.68	3,054.3	92,663
10월물(mini)	312.30	-1.90	-6.04	55.4	9,605

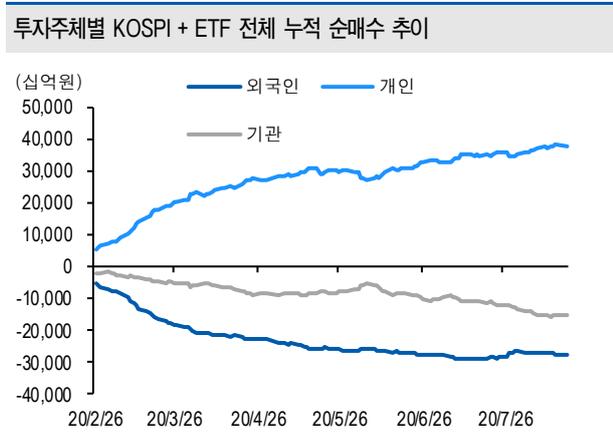


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.13	0.23	0.21	0.03%
베이스스(mini)	0.13	0.22	0.24	0.03%
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.45	-0.45	-0.10%
합성선물 베이스스(ATM)	0.13	0.24	0.24	0.04%

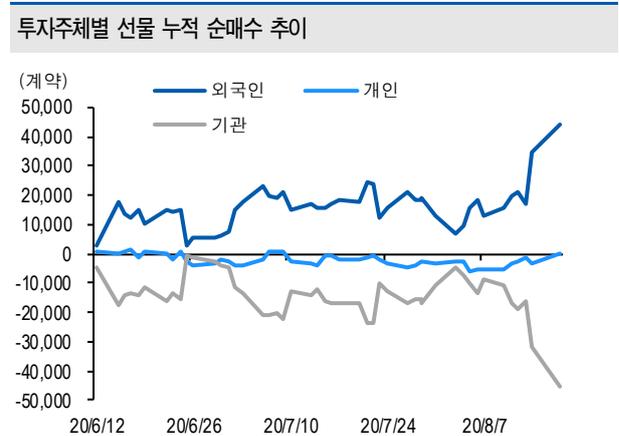


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	71.9	-4.2	67.8	0.0	191.5	74.2	704.2	-3.3	-3.3	30.0
개인	-527.0	11.2	-515.7	0.0	1.0	287.3	8.5	3.8	1.0	18.9
기관	477.2	-11.4	465.8	16.0	-34.9	-379.8	-714.0	0.6	3.1	-47.2
금융투자	662.1	-20.0	642.1	0.0	-2.0	-90.4	-714.2	0.7	2.6	6.0
투신	-70.6	-10.8	-81.4	1.6	-29.2	-276.0	0.2	-0.1	-0.1	-37.3
은행+보험+기타금융	28.6	5.3	33.8	0.0	34.0	3.4	0.0	-0.1	0.6	-0.8
연기금+국가자자체	-102.2	11.3	-90.9	14.4	-35.3	-16.8	0.0	0.0	0.0	-15.1
기타법인	-22.2	4.3	-17.8	0.0	-0.4	18.3	1.3	-1.1	-0.7	-1.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	733,702	273.9	618,258	20.5%	지수옵션 전체	1,586,118	629.1	1,627,057			
Put	852,416	355.2	1,008,799	21.5%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	25.21%(+2.63%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	1.81	-1.36	38,974	6,840	1,730	20.5	Put	322.5(K+1)	12.45	3.77	3,279	2,459	52	20.4
	325.0(K+2)	2.32	-1.64	34,144	11,613	1,138	20.5		320.0(K+0)	10.70	3.38	5,252	4,153	530	20.4
	322.5(K+1)	2.97	-1.93	20,425	9,506	1,035	20.6		317.5(K-1)	9.23	3.05	7,781	4,916	1,109	20.9
	320.0(K+0)	3.78	-2.29	14,521	12,520	1,440	20.8		315.0(K-2)	7.83	2.67	12,860	6,081	541	21.1
	317.5(K-1)	4.75	-2.70	3,511	5,526	493	21.0		312.5(K-3)	6.65	2.31	17,735	3,193	414	21.5

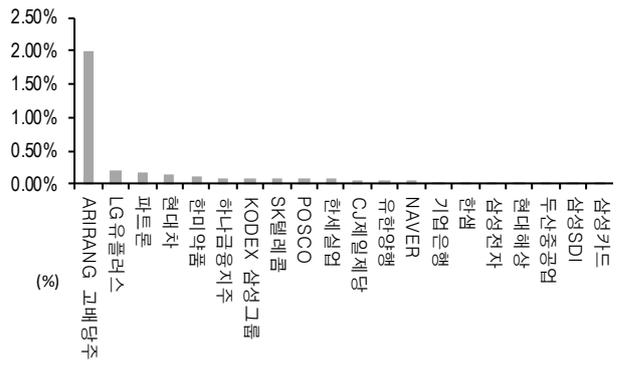
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,291,029	4,713.5	4,731,428	-139,299	24,379	-39,636	18,287	30.0	18.9	-47.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	149,500	-7.14	55.0	83.8	24,044	1,293	-1.18%	2,655	471	-3,127	-1,481	603
삼성 SDI	433,500	-2.14	269.2	79.4	21,060	1,923	0.02%	1,510	888	-2,511	285	-3,964
LG 전자	83,900	-5.41	86.2	69.4	43,230	-8,357	-0.04%	1,362	-89	-1,208	-2,495	7,655
NAVER	307,000	0.33	305.0	65.9	36,247	-2,647	0.04%	873	1,257	-2,143	-5,397	6,293
한국금융지주	60,300	-5.19	35.9	65.6	33,097	-15,594	-0.01%	2,421	-1,973	-928	2,770	4,756
SK 텔레콤	229,000	-3.38	111.6	64.9	32,201	-5,860	0.09%	406	118	-524	-1,752	5,047
삼성전자	58,400	0.17	903.8	61.7	1,205,388	7,864	0.03%	-1,144	19,341	-15,820	-2,852	-18,060
기아차	42,750	-3.82	49.5	60.7	51,700	-4,848	-0.24%	3,299	54	-3,353	755	6,424
대림산업	82,800	-5.15	19.5	60.5	16,259	-2,914	0.00%	-66	-2,879	3,045	479	2,584
현대차	158,500	-5.09	399.5	57.6	112,849	2,954	0.13%	3,166	5,758	-8,723	4,476	-9,911

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터