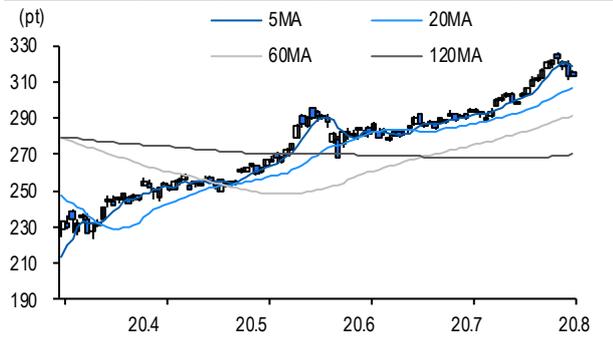


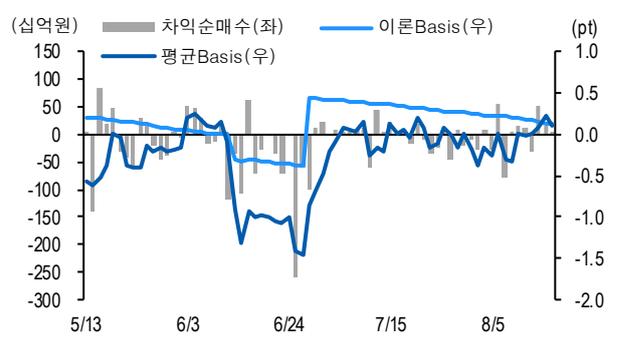


선물옵션시장 지표 2020.8.20

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.54	0.22	0.70	8,433.5	-
선물 9월물	313.45	0.13	0.40	20,596.0	297,068
선물 12월물	313.05	0.14	0.45	137.7	38,455
9월물(mini)	313.46	0.13	0.38	2,158.0	91,420
10월물(mini)	312.92	0.20	0.62	50.3	11,707

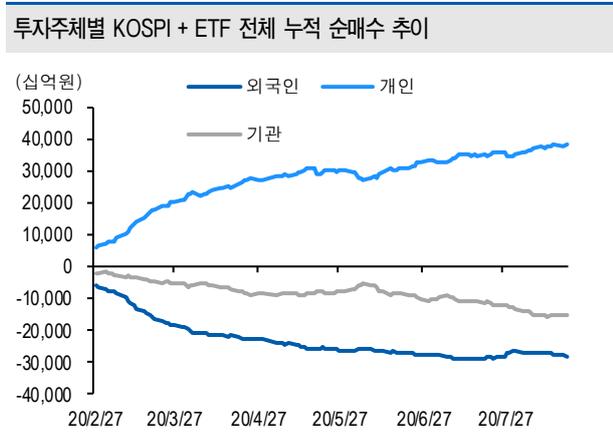


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.12	0.11	-0.09	0.00%
베이스스(mini)	0.12	0.11	-0.08	0.00%
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.43	-0.40	-0.09%
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	-0.14	-0.14	-0.08%

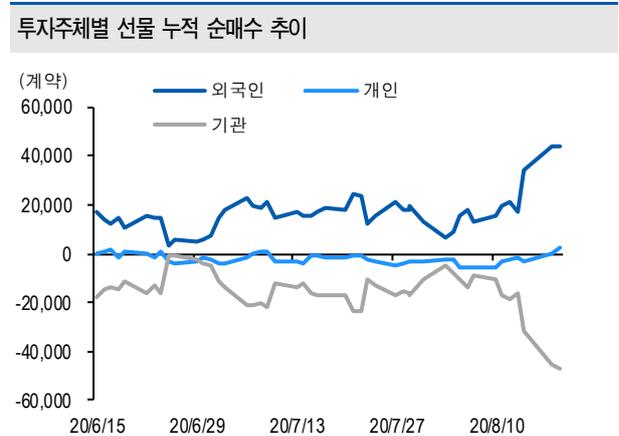


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-249.6	13.6	-236.0	2.7	-148.3	9.8	-19.7	-1.6	-0.2	-26.2
개인	459.8	-56.1	403.8	0.0	-0.5	162.9	-4.9	-2.1	0.2	18.8
기관	-231.7	49.3	-182.4	-1.6	-59.9	-180.4	24.4	3.9	-0.3	10.8
금융투자	7.1	122.4	129.5	0.0	-2.1	19.2	24.7	3.9	-0.3	18.9
투신	-120.2	-37.7	-157.9	0.0	-47.3	-135.1	-0.3	0.0	0.0	-13.8
은행+보험+기타금융	-25.2	14.2	-10.9	0.0	6.7	-67.3	0.0	0.0	0.0	-0.9
연기금+국가자자체	-87.3	15.2	-72.1	-1.6	-22.5	2.8	0.0	0.0	0.0	6.7
기타법인	21.4	-6.8	14.6	0.0	-0.3	7.8	0.3	-0.2	0.3	-3.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	540,877	206.1	638,723	19.9%	지수옵션 전체	1,154,392	455.8	1,678,596
Put	613,515	249.6	1,039,873	22.9%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	24.38%(-0.83%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	3.60	-0.18	18,959	12,946	426	19.7	Put	315.0(K+1)	7.34	-0.49	7,193	6,471	390	21.1
	317.5(K+2)	4.60	-0.15	9,910	6,720	1,194	20.0		312.5(K+0)	6.20	-0.45	7,048	3,984	791	21.6
	315.0(K+1)	5.77	-0.11	7,020	10,589	1,023	20.4		310.0(K-1)	5.20	-0.43	15,729	9,876	161	22.0
	312.5(K+0)	7.10	-0.09	4,674	3,747	178	20.7		307.5(K-2)	4.37	-0.47	18,196	6,935	-374	22.6
	310.0(K-1)	8.65	0.01	1,271	4,651	134	21.3		305.0(K-3)	3.73	-0.34	32,478	10,269	352	23.4

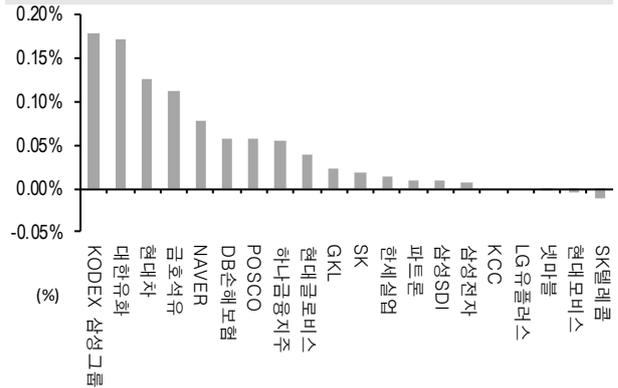
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,033,106	3,627.7	4,765,044	33,616	6,723	14,247	-11,685	-26.2	18.8	10.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	152,000	1.67	21.5	91.5	22,548	-1,496	-1.31%	-205	-267	472	862	-430
LG 전자	85,000	1.31	89.5	79.2	40,046	-3,184	-0.08%	-1,340	1,327	12	4,976	13
삼성전자	57,800	-1.03	760.8	77.4	1,208,454	3,066	0.01%	-42,187	23,049	28,327	3,172	26,774
NAVER	315,000	2.61	225.8	77.0	44,851	8,604	0.08%	-860	-914	1,469	-977	-3,223
현대차	164,500	3.79	403.6	76.1	116,722	3,873	0.13%	-2,710	1,200	1,137	-250	345
삼성 SDI	433,500	0.00	157.5	66.3	20,902	-158	0.01%	-370	153	603	-185	-322
카카오	376,500	-0.53	319.7	62.5	40,445	-1,374	-0.04%	-979	-1,739	2,849	1,302	1,340
한국금융지주	60,700	0.66	16.7	59.6	30,691	-2,406	-0.16%	733	-161	-572	-392	694
KB 금융	37,950	-0.52	29.1	59.5	84,458	-405	-0.17%	3,788	464	-4,252	2,184	-2,046
호텔신라	73,300	2.66	28.8	58.3	23,395	2,363	-0.07%	2,145	-410	-1,735	635	-2,792

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터