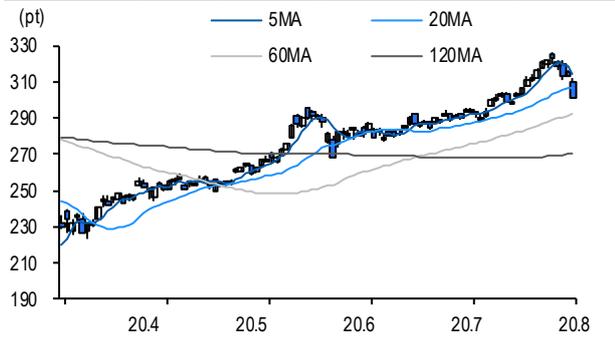


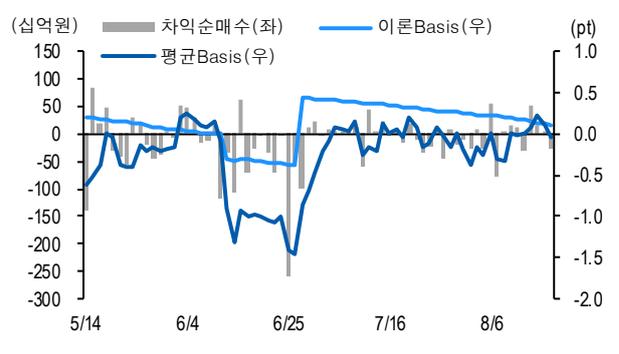


선물옵션시장 지표 2020.8.21

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	301.59	-3.81	-11.95	11,655.4	-
선물 9월물	301.45	-3.83	-12.00	31,615.2	300,386
선물 12월물	301.15	-3.80	-11.90	359.0	38,956
9월물(mini)	301.50	-3.82	-11.96	3,700.2	86,662
10월물(mini)	300.96	-3.82	-11.96	31.8	12,167

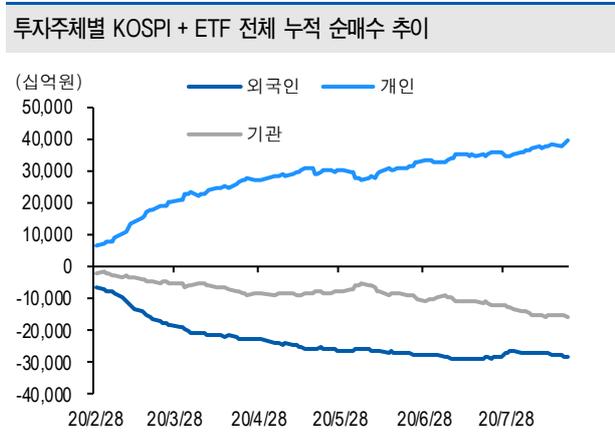


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.11	-0.04	-0.14	-0.05%
베이스스(mini)	0.11	-0.03	-0.09	-0.05%
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.43	-0.45	-0.09%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	-0.15	-0.15	-0.09%

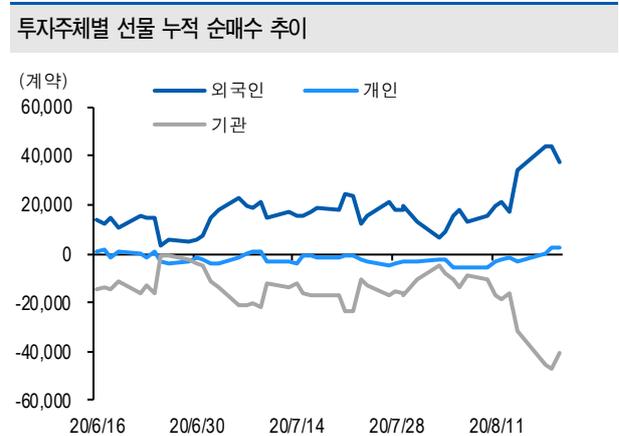


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-273.1	20.6	-252.5	0.0	-95.6	-195.6	-346.9	-7.9	20.4	63.0
개인	1,074.8	65.6	1,140.5	0.0	-0.4	-36.4	29.4	3.3	-10.3	-93.6
기관	-821.3	-68.2	-889.6	-26.4	-66.5	204.7	316.0	6.3	-10.2	33.3
금융투자	-485.0	-51.2	-536.2	-3.1	5.6	746.8	316.3	3.2	-7.7	93.8
투신	-97.5	4.8	-92.7	0.0	-43.3	-483.7	-0.4	0.0	0.6	-74.4
은행+보험+기타금융	-83.8	3.7	-80.1	0.0	-3.6	-79.5	0.0	3.0	-3.1	4.6
연기금+국가자자체	-89.7	-2.2	-91.9	-23.3	-20.3	21.2	0.0	0.0	0.0	9.3
기타법인	19.6	-18.0	1.6	0.0	-0.1	27.3	1.5	-1.6	0.1	-2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,108,565	328.5	682,341	22.5%	지수옵션 전체	2,556,523	1,006.5	1,765,902
Put	1,447,958	678.0	1,083,561	24.4%	PCR(금액기준)	2.06	VKOSPI	28.18%(+3.80%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.25	-2.35	100,144	18,364	5,418	22.4	Put	315.0(K+1)	15.40	8.06	3,065	5,783	-688	22.5
	317.5(K+2)	1.64	-2.96	75,085	11,652	4,932	22.5		312.5(K+0)	13.85	7.65	4,590	3,862	-122	24.0
	315.0(K+1)	2.17	-3.60	53,210	12,369	1,780	22.7		310.0(K-1)	12.05	6.85	12,155	8,958	-918	23.9
	312.5(K+0)	2.79	-4.31	29,865	4,904	1,157	22.9		307.5(K-2)	10.45	6.08	9,792	6,433	-502	24.1
	310.0(K-1)	3.57	-5.08	16,879	5,349	698	23.2		305.0(K-3)	9.09	5.36	19,359	10,083	-186	24.7

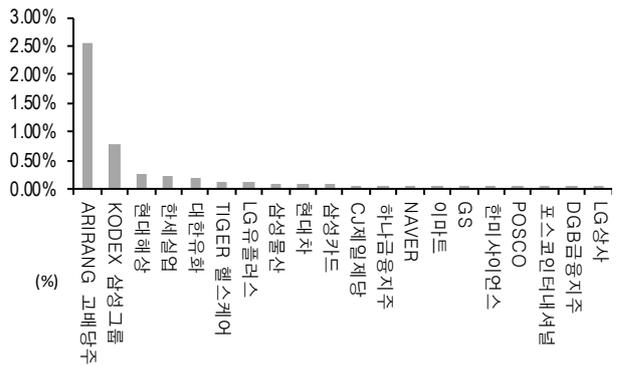
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,838,540	5,074.9	4,838,382	73,338	85,874	-108,518	25,416	63.0	-93.6	33.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 생활건강	1,502,000	-1.25	49.9	90.6	695	90	-0.13%	70	-287	217	129	117
삼성 SDI	417,000	-3.81	276.1	90.5	19,610	-1,292	-0.02%	-524	-809	1,512	545	941
LG 전자	85,100	0.12	105.8	87.4	52,223	12,177	-0.04%	-701	-2,233	3,122	5,236	-7,430
현대차	155,000	-5.78	496.4	87.3	108,438	-8,284	0.07%	314	-2,787	2,859	1,859	5,441
NAVER	305,500	-3.02	291.5	79.1	47,523	2,672	0.04%	821	-154	-446	-3,270	1,947
LG 화학	667,000	-2.20	443.9	78.4	32,616	1,641	-0.08%	2,136	-1,369	-866	-179	-2,244
SK 텔레콤	227,500	-1.52	111.8	72.2	22,706	-8,145	-0.07%	-459	-7,412	7,911	2,785	5,974
삼성전자	55,600	-3.81	1,157.5	67.9	1,173,473	-34,981	-0.14%	24,976	-58,433	33,723	95,568	-7,905
카카오	364,500	-3.19	411.7	66.2	41,604	1,159	-0.03%	1,514	-819	-649	1,197	-1,870
LG 이노텍	143,000	-5.92	28.8	60.5	22,003	-545	-1.17%	-1,058	-46	1,106	2,291	-203

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터