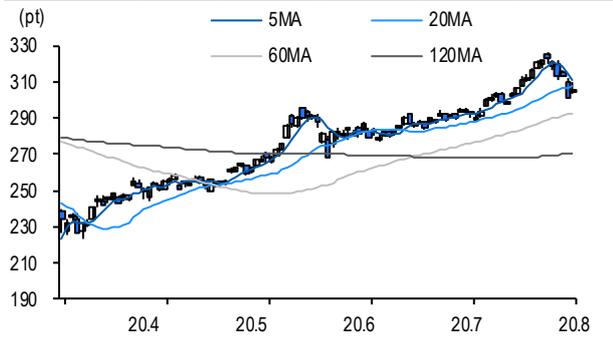


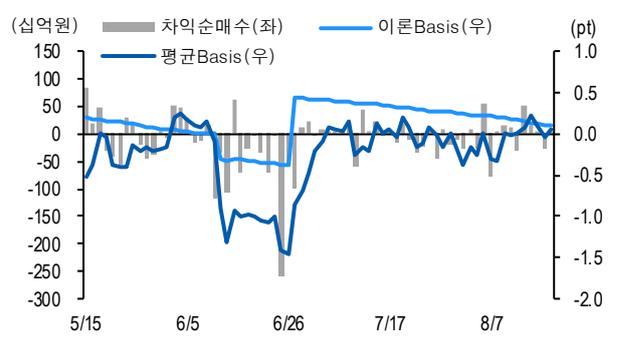


선물옵션시장 지표 2020.8.24

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	306.16	1.52	4.57	8,825.9	-
선물 9월물	306.95	1.82	5.50	25,870.9	293,757
선물 12월물	306.55	1.79	5.40	169.3	38,973
9월물(mini)	306.94	1.82	5.44	2,748.2	92,549
10월물(mini)	306.24	1.75	5.28	51.5	13,577

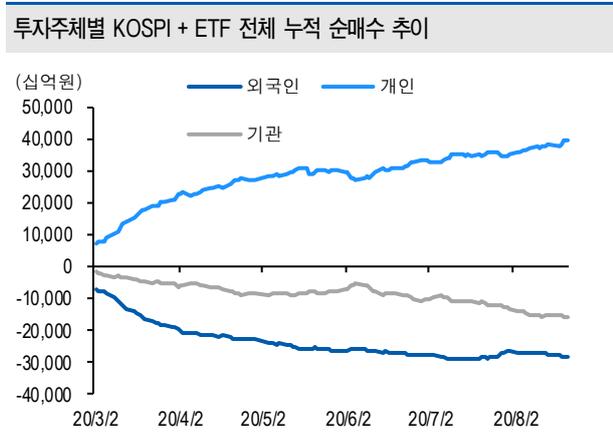


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.11	0.05	0.79	-0.02%
베이스스(mini)	0.11	0.05	0.78	-0.02%
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.42	-0.40	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	0.53	0.53	0.14%

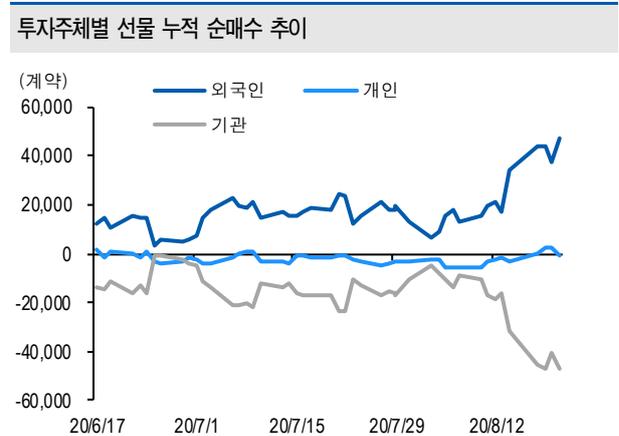


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	196.8	12.0	208.9	0.0	263.6	644.8	115.4	-7.2	1.0	-21.4
개인	-135.5	-40.1	-175.6	0.0	3.0	-205.7	-41.6	5.8	2.3	50.9
기관	-33.5	31.7	-1.8	5.7	-116.0	-426.5	-73.3	1.8	-2.7	-32.6
금융투자	107.8	33.5	141.2	0.0	0.8	-688.8	-73.1	2.2	-1.6	-20.5
투신	-113.5	-10.8	-124.3	0.0	-67.5	379.5	-0.2	-0.4	-0.1	14.2
은행+보험+기타금융	-4.5	25.4	21.0	0.0	-4.8	-114.0	0.0	0.0	-1.0	0.9
연기금+국가자자체	0.9	-8.6	-7.8	5.7	-31.5	-3.1	0.0	0.0	0.0	-27.1
기타법인	-27.8	-3.6	-31.4	0.0	0.2	-12.6	-0.5	-0.4	-0.6	3.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,151,171	460.7	709,265	24.3%	지수옵션 전체	2,204,999	877.9	1,849,275
Put	1,053,828	417.2	1,140,010	25.6%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	26.89%(-1.29%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	5.42	1.85	23,329	5,329	-20	24.2	Put	305.0(K+1)	6.18	-2.91	11,403	11,017	934	23.2
	307.5(K+2)	6.68	2.19	10,426	3,785	484	24.8		302.5(K+0)	5.28	-2.54	14,846	9,049	-16	24.1
	305.0(K+1)	8.10	2.53	9,128	4,533	1,068	25.5		300.0(K-1)	4.51	-2.25	31,114	15,703	-657	24.9
	302.5(K+0)	9.47	2.65	5,213	1,637	383	25.5		297.5(K-2)	3.83	-2.00	34,589	9,255	1,288	25.6
	300.0(K-1)	11.45	3.18	1,222	3,581	88	27.3		295.0(K-3)	3.28	-1.76	50,924	15,163	50	26.5

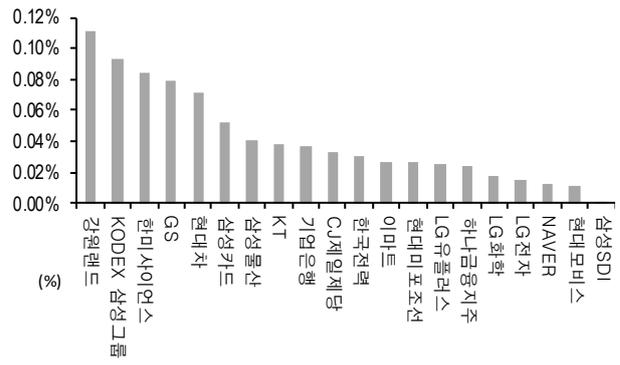
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,076,832	4,344.4	4,922,732	84,350	-23,673	21,699	1,713	-21.4	50.9	-32.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	424,500	1.80	246.2	92.5	21,243	1,633	0.00%	374	1,213	-1,304	-602	-1,398
코웨이	83,600	-1.18	13.9	92.0	3,267	-109	-0.07%	-141	-74	215	384	-172
삼성전자	55,700	0.18	1,026.9	86.4	1,158,053	-15,420	-0.08%	-1,180	4,010	-3,893	-11,588	32,967
현대차	157,000	1.29	421.0	80.2	116,804	8,366	0.07%	1,380	4,378	-5,909	2,190	-8,152
LG 화학	700,000	4.95	538.6	72.2	38,491	5,875	0.02%	-1,729	2,955	-1,609	-1,594	-2,809
현대건설	32,650	1.56	17.5	70.8	29,082	6,706	-0.08%	3,377	-433	-2,944	-4,388	-3,582
NAVER	313,000	2.45	160.9	66.9	48,377	854	0.01%	-532	398	121	-1,649	1,187
LG 전자	90,500	6.35	176.5	66.3	78,489	26,266	0.02%	-2,775	3,965	-1,341	-3,280	-11,609
기아차	40,650	0.62	45.9	61.8	62,679	7,357	-0.56%	-2,890	370	2,520	-1,101	20
LG 이노텍	145,500	1.75	15.5	61.7	21,941	-62	-0.78%	226	-96	-129	-551	27

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터