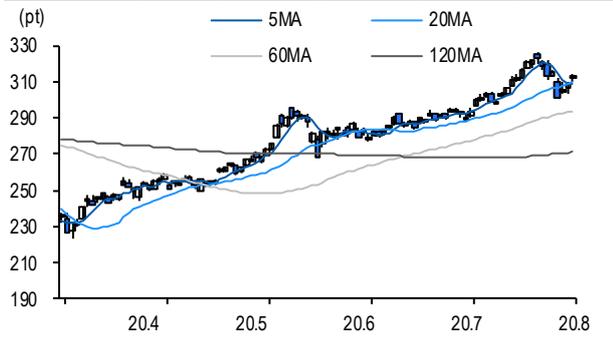


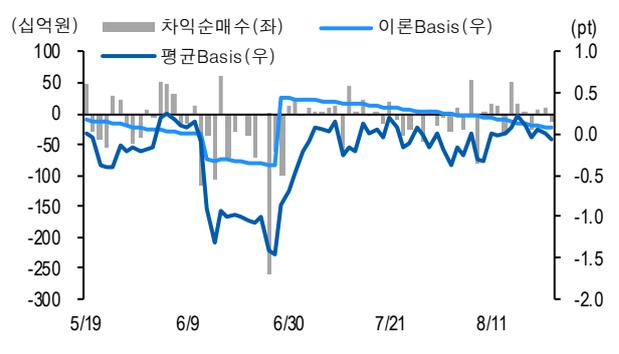


선물옵션시장 지표 2020.8.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.59	1.38	4.26	8,213.9	-
3월물(big)	314.25	1.14	3.55	18,981.2	287,718
6월물(big)	313.75	1.16	3.60	96.6	38,891
1월물(mini)	314.00	1.06	3.34	2,001.8	85,194
2월물(mini)	313.70	1.17	3.64	29.8	17,858

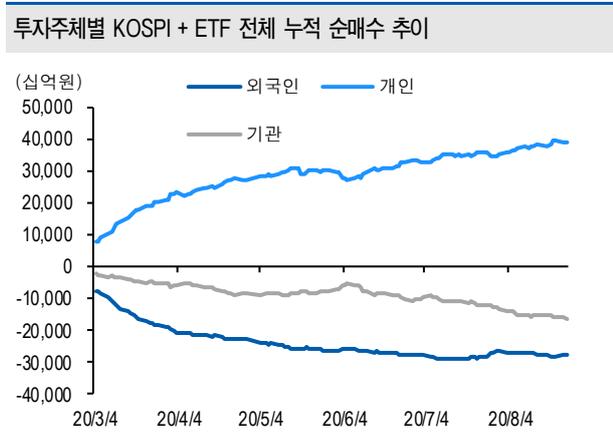


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.09	-0.06	0.66	-0.05%
베이스스(mini)	0.09	-0.06	0.41	-0.05%
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.40	-0.40	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	0.09	0.62	0.62	0.17%

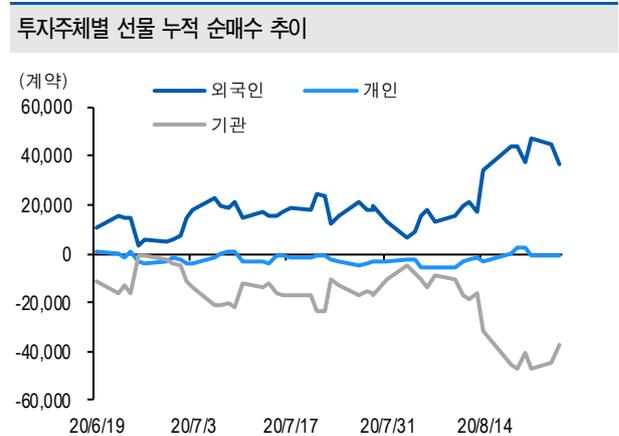


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	151.8	18.6	170.4	0.0	17.1	-390.5	-273.8	7.4	0.4	-1.3
개인	-65.7	-19.2	-84.9	0.0	0.0	32.8	8.1	-5.2	-0.7	50.3
기관	-123.3	-4.0	-127.3	-12.2	0.2	351.0	265.1	-1.6	0.8	-51.3
금융투자	-133.8	38.1	-95.7	0.0	6.0	102.2	264.2	-1.7	0.9	-68.6
투신	-17.4	2.3	-15.1	0.0	-11.5	215.9	0.9	0.1	-0.1	42.7
은행+보험+기타금융	12.4	18.9	31.4	0.0	2.9	20.7	0.0	0.0	0.0	-0.6
연기금+국가자자체	5.1	-64.0	-58.9	-12.2	-3.5	12.3	0.0	0.0	0.0	-24.8
기타법인	37.2	4.7	41.9	0.0	0.1	6.7	0.6	-0.6	-0.5	2.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





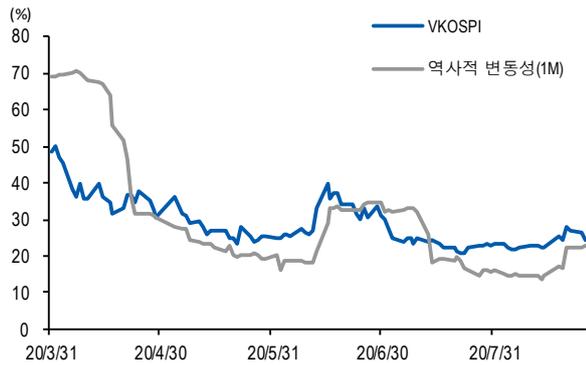
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	697,663	312.3	706,675	22.1%	지수옵션 전체	1,490,230	561.1	1,907,085
Put	792,567	248.8	1,200,410	24.3%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	24.63%(-1.81%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	4.26	0.87	51,400	10,735	-3,993	22.0	Put	312.5(K+1)	5.20	-2.29	5,587	3,659	-123	21.4
	315.0(K+2)	5.43	1.13	29,596	13,247	-2,056	22.4		310.0(K+0)	4.30	-1.96	11,994	9,102	205	22.2
	312.5(K+1)	6.93	1.43	12,020	6,481	-581	23.5		307.5(K-1)	3.56	-1.71	15,496	7,737	70	23.1
	310.0(K+0)	8.51	1.66	5,087	6,107	-661	24.2		305.0(K-2)	2.93	-1.50	30,934	11,706	-899	23.8
	307.5(K-1)	10.15	1.72	2,032	3,643	-341	24.7		302.5(K-3)	2.44	-1.30	29,994	7,656	-1,103	24.8

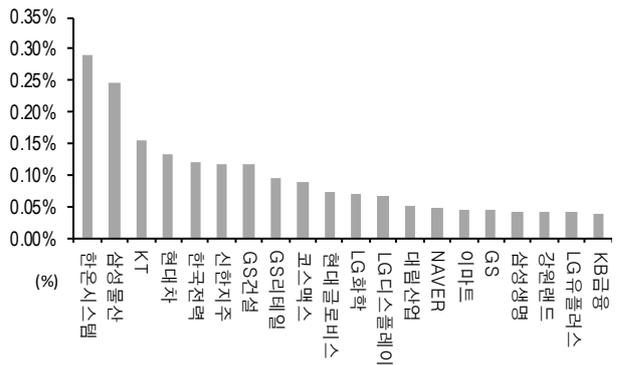
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,520,081	3,354.3	5,273,683	153,315	55,565	72,463	-136,056	-1.3	50.3	-51.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
금호석유	167,000	2.77	478.2	86.5	137,435	12,236	0.13%	-361	3,690	-3,909	-8,988	-2,590
메디톡스	56,400	0.53	644.9	82.8	1,158,388	-6,483	-0.05%	7,852	12,624	-23,927	-33,319	-22,251
셀트리온	714,000	1.42	249.7	78.8	39,765	1,114	0.07%	226	2,212	-2,239	-474	-201
대림산업	90,300	-0.44	82.9	78.8	80,471	-1,753	0.02%	-77	-812	910	-809	2,750
현대모비스	42,900	2.88	85.4	71.3	65,492	-334	-0.17%	-865	1,815	-950	-9,530	-2,639
엔씨소프트	444,000	1.25	123.3	68.4	20,880	-774	-0.04%	-1,462	350	983	539	738
CJ 오쇼핑	382,500	0.92	217.0	64.6	36,854	-2,440	-0.01%	-886	-396	1,286	-1,005	2,275
호텔신라	76,800	1.86	164.0	62.7	157,047	-3,482	-0.14%	3,455	-3,519	985	-6,078	-2,229
현대차	325,500	1.72	167.8	58.4	54,853	272	0.05%	-897	-1,605	2,495	-524	1,975
SK 하이닉스	24,350	1.67	14.3	58.2	92,575	12,382	0.16%	3,090	13,266	-16,356	-10,873	-5,469

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터