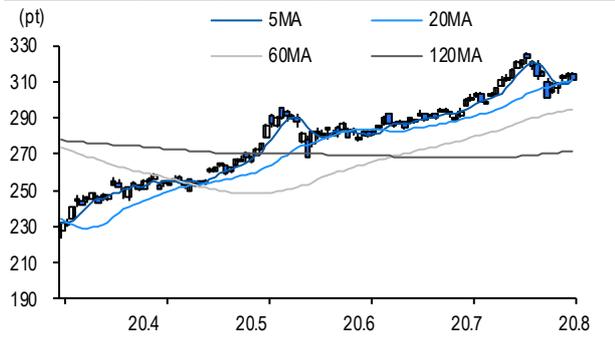


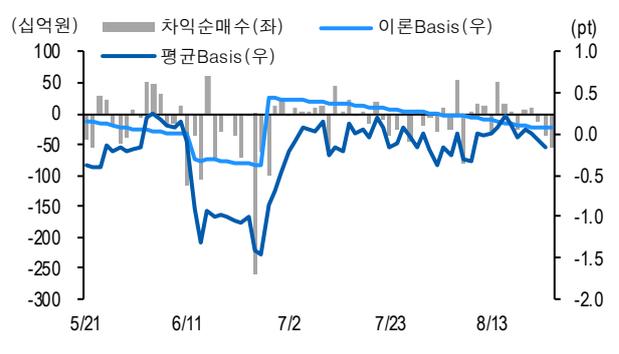


선물옵션시장 지표 2020.8.28

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.38	-0.89	-2.81	9,114.3	-
3월물(big)	310.80	-1.02	-3.20	22,911.6	290,152
6월물(big)	310.40	-0.99	-3.10	142.0	39,096
1월물(mini)	310.74	-1.04	-3.24	2,315.2	95,272
2월물(mini)	310.32	-1.01	-3.16	51.5	24,936

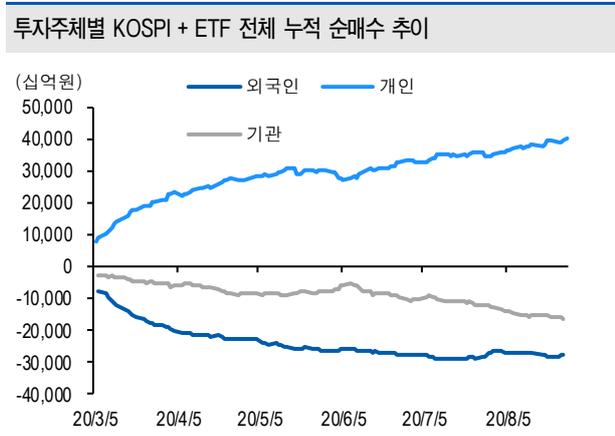


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.08	-0.28	-0.58	-0.11%	
베이스스(mini)	0.08	-0.28	-0.64	-0.11%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.38	-0.40	-0.07%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	-0.58	-0.58	-0.21%	

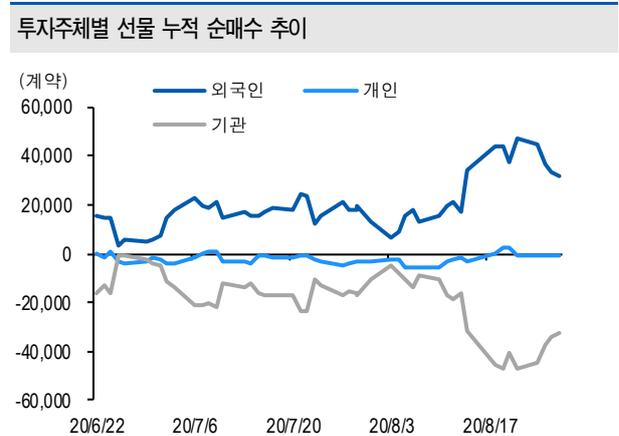


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-26.2	0.9	-25.3	12.8	-23.2	304.4	-417.4	-1.0	-1.0	-83.4	
개인	468.7	23.9	492.6	0.0	0.8	25.9	0.6	2.6	-0.6	24.1	
기관	-473.1	-29.8	-502.9	-68.0	-88.3	-329.5	416.4	-0.9	1.3	58.5	
금융투자	-343.7	20.0	-323.7	-26.5	-1.8	-176.5	416.4	-0.7	1.0	13.5	
투신	-54.8	0.8	-54.0	0.0	-39.7	-216.2	0.0	-0.2	0.3	27.7	
은행+보험+기타금융	-18.1	-41.3	-59.4	-2.3	-21.9	24.8	0.0	0.0	0.0	-0.7	
연기금+국가자자체	-39.2	4.5	-34.7	-39.2	-2.8	38.5	0.0	0.0	0.0	18.0	
기타법인	30.6	4.9	35.5	0.0	-0.2	-0.9	0.4	-0.6	0.3	0.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

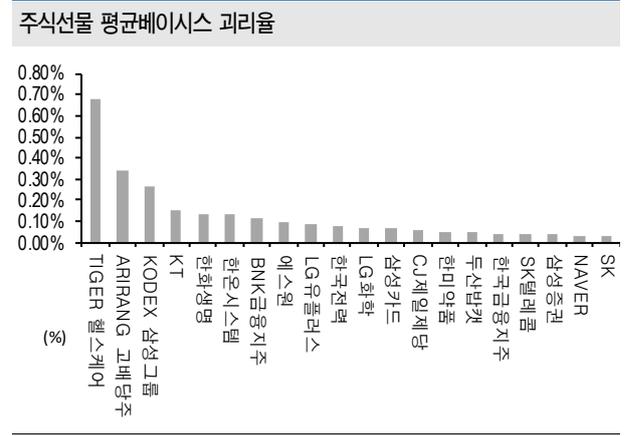
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	679,913	257.3	737,342	22.2%	지수옵션 전체	1,559,145	579.9	1,995,496
Put	879,232	322.6	1,258,154	26.8%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI	27.22%(+1.78%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.79	-0.66	72,241	17,548	358	22.2	Put	317.5(K+1)	9.67	1.86	1,045	4,541	3	24.3
	320.0(K+2)	2.40	-0.85	58,993	17,520	553	22.2		315.0(K+0)	8.32	1.81	1,954	6,498	139	25.3
	317.5(K+1)	3.16	-1.12	32,765	16,738	-782	22.3		312.5(K-1)	7.02	1.62	12,605	5,361	1,237	25.7
	315.0(K+0)	4.12	-1.37	15,825	13,326	662	22.6		310.0(K-2)	5.88	1.40	13,958	8,860	-302	26.2
	312.5(K-1)	5.30	-1.59	7,624	7,053	553	23.0		307.5(K-3)	4.94	1.22	20,734	6,906	-1,330	26.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	3,916,836	3,976.3	5,289,467	-31,963	-62,577	4,572	60,289	-83.4	24.1	58.5		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	86,200	-1.82	100.4	87.4	33,385	-24,663	-0.13%	4,778	2,912	-7,695	5,177	6,659
NAVER	337,000	0.90	319.5	76.2	62,665	1,582	0.04%	-584	1,086	-477	-2,103	337
현대차	163,000	-2.98	301.9	75.4	106,394	-24,441	-0.06%	-1,247	1,659	-464	4,486	10,964
카카오	411,000	5.25	586.9	73.1	44,314	7,675	0.03%	-2,625	-2,023	4,659	533	-3,540
LG 화학	762,000	0.26	568.5	71.3	48,226	43	0.07%	-2,488	596	1,911	-187	1,949
삼성전자	55,600	-1.24	592.2	67.5	1,200,820	-13,373	-0.07%	-70,288	-304	75,518	34,771	-3,651
롯데케미칼	180,000	4.35	41.5	62.5	9,678	3,679	0.01%	327	1,629	-3,886	-3,162	-1,711
삼성전기	128,500	0.00	32.6	62.4	26,648	1,298	-0.29%	183	1,138	-1,323	-1,843	-3,153
삼성 SDI	469,500	2.85	222.4	61.8	22,216	714	-0.03%	-977	149	816	-299	952
기아차	41,750	-2.91	38.5	59.5	58,831	-6,004	-0.26%	-556	-1,568	2,134	4,731	2,367

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

