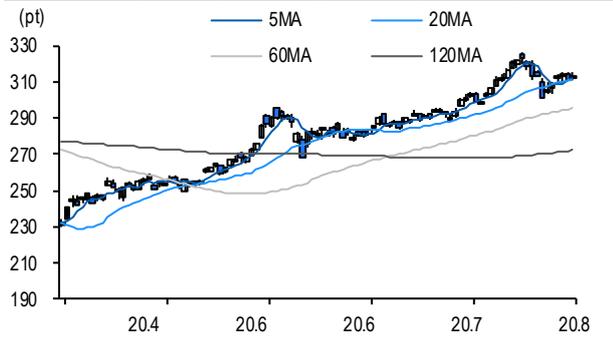


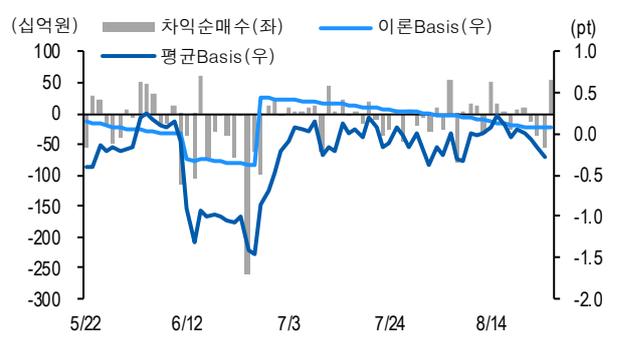


선물옵션시장 지표 2020.8.31

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.24	0.28	0.86	9,453.9	-
3월물(big)	312.95	0.69	2.15	24,999.4	287,495
6월물(big)	312.65	0.72	2.25	95.2	39,053
1월물(mini)	312.80	0.64	2.06	2,404.4	96,654
2월물(mini)	312.44	0.68	2.12	37.9	24,893

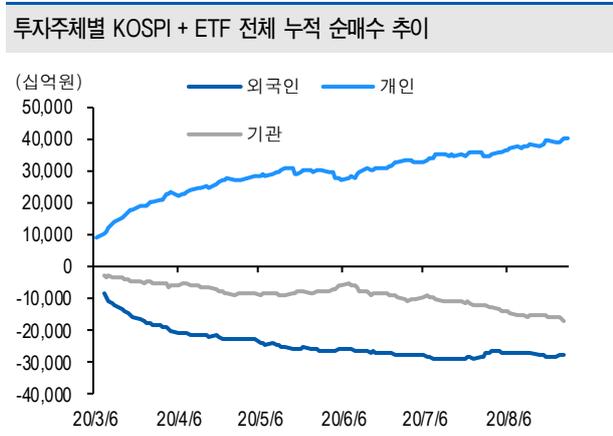


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.07	-0.08	0.71	-0.05%	
베이스스(mini)	0.07	-0.08	0.56	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.40	-0.35	-0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.07	0.73	0.73	0.21%	

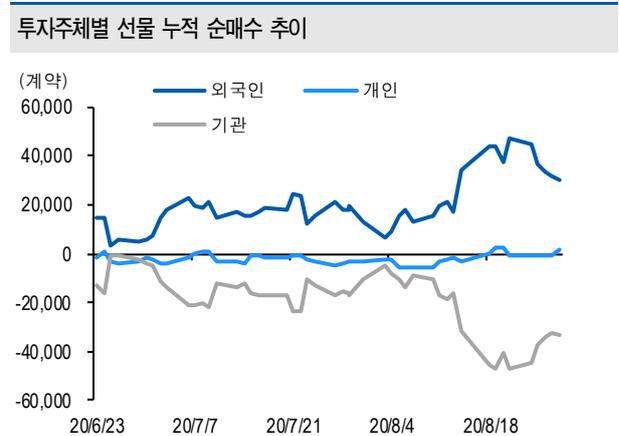


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체	
외국인	-228.7	16.4	-212.3	0.0	-185.4	-172.2	31.2	0.0	-4.2	-2.8	
개인	116.4	-82.4	33.9	0.0	0.4	206.7	-10.8	-0.1	1.7	15.2	
기관	118.4	66.9	185.3	53.5	-77.9	-41.1	-21.2	-0.4	2.5	-11.8	
금융투자	186.5	35.9	222.4	-1.6	2.6	34.9	-21.2	-0.3	2.8	-28.1	
투신	-29.8	5.1	-24.7	0.0	-19.5	-37.5	0.1	-0.1	-0.2	12.9	
은행+보험+기타금융	-43.4	25.3	-18.0	0.0	-32.0	20.2	0.0	0.1	-0.1	0.7	
연기금+국가자자체	3.8	3.4	7.1	55.1	-13.1	-58.8	0.0	0.0	0.0	2.7	
기타법인	-6.1	-0.8	-6.9	0.0	0.7	6.6	0.7	0.5	-0.1	-0.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





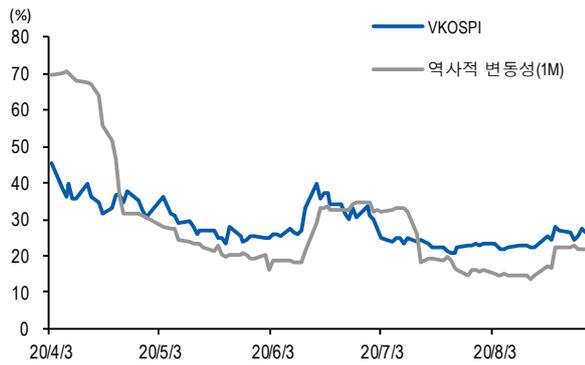
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	991,013	381.1	747,190	23.0%	지수옵션 전체	2,104,173	747.4	2,053,549
Put	1,113,160	366.2	1,306,359	24.5%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	26.40%(-0.82%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	2.61	0.21	91,440	18,949	1,429	22.8	Put	315.0(K+1)	6.67	-1.65	4,163	6,702	204	21.3
	317.5(K+2)	3.56	0.40	50,234	18,371	1,633	23.5		312.5(K+0)	5.51	-1.51	12,752	6,079	718	22.2
	315.0(K+1)	4.65	0.53	24,981	13,736	410	24.1		310.0(K-1)	4.53	-1.35	19,786	8,914	54	23.1
	312.5(K+0)	5.98	0.68	10,531	7,539	486	24.9		307.5(K-2)	3.72	-1.22	30,455	7,845	939	24.0
	310.0(K-1)	7.51	0.84	5,606	6,393	106	25.9		305.0(K-3)	3.06	-1.06	44,741	11,141	772	25.0

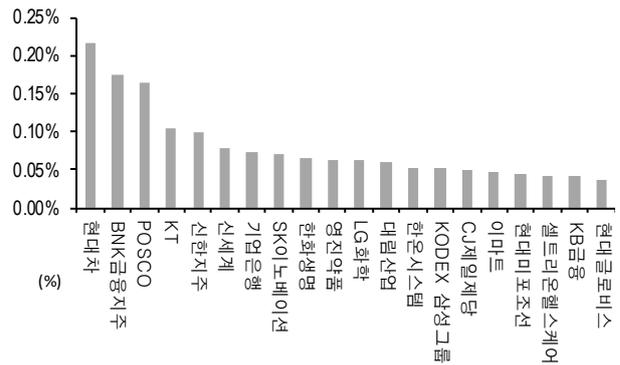
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,172,929	3,973.4	5,426,206	136,739	55,451	17,057	-72,421	-2.8	15.2	-11.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	761,000	-0.13	327.3	86.9	47,626	-600	0.06%	-412	430	-19	-902	712
삼성전자	55,600	0.00	670.3	82.6	1,225,428	24,608	0.01%	-4,200	18,318	-14,128	-5,943	-9,100
LG 전자	85,500	-0.81	64.0	78.0	24,549	-8,836	-0.26%	3,379	871	-4,270	3,280	-320
삼성 SDI	466,000	-0.75	166.2	77.2	20,398	-1,818	-0.08%	-1,911	-156	2,085	449	2,146
호텔신라	70,800	1.58	20.4	75.7	19,192	1,544	-0.03%	-141	1,264	-1,123	2,062	-5,844
SK 하이닉스	77,700	-1.65	137.8	71.7	167,928	-8,459	-0.04%	-9,814	4,554	5,266	773	10,151
현대건설	32,650	3.32	15.9	71.0	23,135	-64	-0.08%	8,855	194	-9,049	-7,303	-6,810
NAVER	333,500	-1.04	216.6	69.6	59,804	-2,861	0.00%	190	-1,404	1,204	1,609	-324
카카오	404,500	-1.58	416.4	68.5	36,886	-7,428	-0.18%	-2,518	-447	2,994	-589	9,113
SK 이노베이션	157,500	1.61	119.2	63.9	49,881	6,019	0.07%	1,985	756	-2,722	-3,061	-2,921

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

