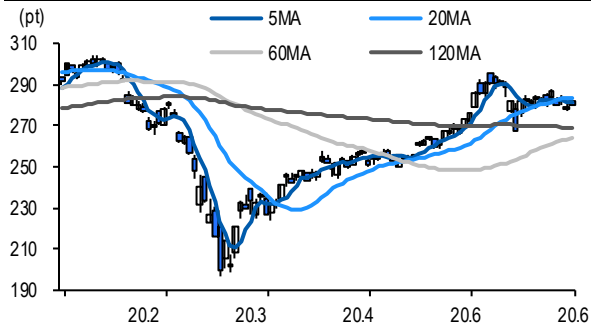
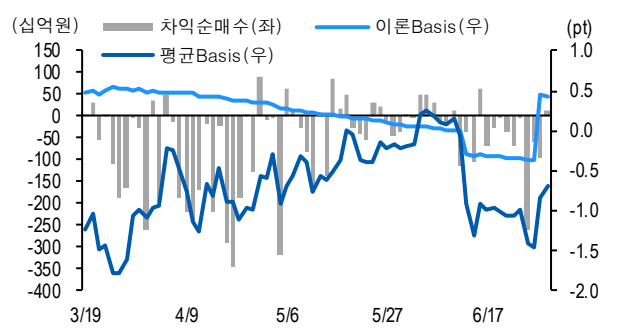


선물옵션시장 지표 2020.7.1

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	280.09	0.74	2.05	8,035.1	-
선물 9월물	280.80	0.95	2.65	20,580.7	288,344
선물 12월물	279.85	1.12	3.10	75.5	39,165
7월물(mini)	280.92	0.80	2.22	2,067.8	75,148
8월물(mini)	279.28	0.38	1.06	10.9	16,215

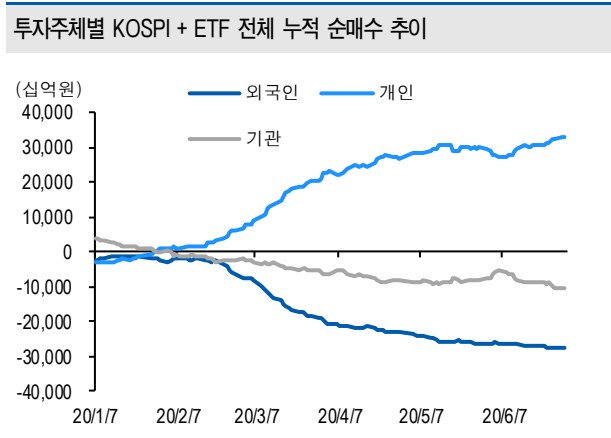


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.44	-0.70	0.71	-0.41%	
베이스스(mini)	0.05	-0.15	0.83	-0.07%	
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.71	-0.70	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.05	1.10	1.10	0.37%	

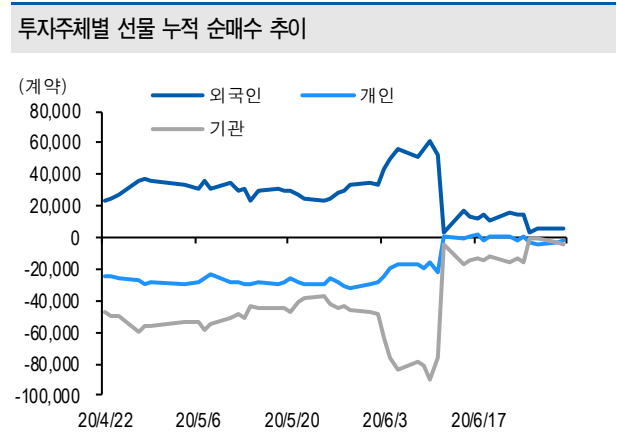


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-72.0	39.7	-32.3	-10.4	-248.7	-50.3	119.8	-0.8	-0.1	-2.0	
개인	-165.3	-100.9	-266.2	0.0	-0.6	116.3	-6.9	0.9	-0.9	30.4	
기관	239.8	63.9	303.7	22.7	-11.6	12.5	-113.5	0.1	1.2	-29.7	
금융투자	133.8	73.6	207.4	-45.2	2.0	-127.3	-113.4	0.5	1.0	-2.2	
투신	15.4	-3.5	11.9	-2.8	-4.2	162.8	-0.1	0.0	-0.1	23.1	
은행+보험+기타금융	-0.3	2.0	1.7	0.0	-8.1	48.2	0.0	-0.3	0.3	-1.9	
연기금+국가자자체	122.3	-7.4	114.9	70.7	5.2	-71.1	0.0	0.0	0.0	-48.8	
기타법인	-2.5	-2.7	-5.2	0.0	-0.1	-78.5	0.6	-0.2	-0.1	1.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

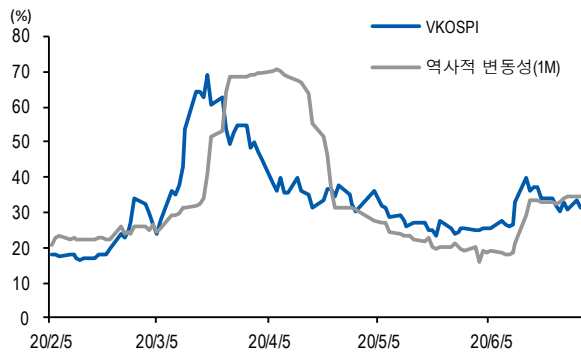
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	886,518	288.3	765,029	28.6%	지수옵션 전체	1,828,444	580.3	2,007,257
Put	941,926	292.0	1,242,228	29.7%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	31.07%(-2.51%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	285.0(K+3)	3.28	0.26	42,804	9,293	637	28.7	Put	280.0(K+1)	4.70	-1.77	17,652	9,795	308	25.8
	282.5(K+2)	4.47	0.44	14,537	4,925	-202	30.0		277.5(K+0)	3.80	-1.59	25,204	6,681	1,019	27.2
	280.0(K+1)	5.89	0.60	10,860	8,689	-218	31.4		275.0(K-1)	3.13	-1.34	62,945	9,521	548	29.0
	277.5(K+0)	7.49	0.87	1,735	4,656	-49	33.0		272.5(K-2)	2.49	-1.21	39,833	7,210	457	30.1
	275.0(K-1)	8.66	0.41	582	3,613	36	31.2		270.0(K-3)	2.03	-1.03	77,104	19,339	1,295	31.6

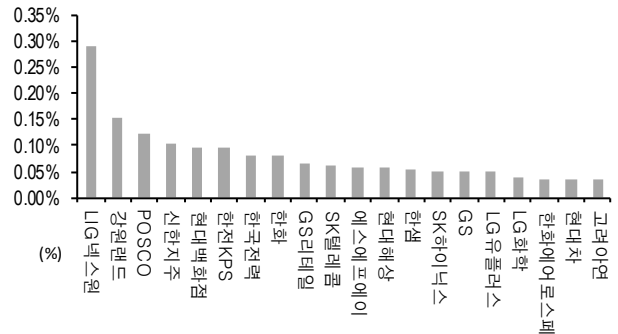
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,186,888	3,117.5	5,196,850	6,364	-60,815	27,553	34,445	-2.0	30.4	-29.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	491,000	0.10	211.5	97.0	32,306	343	0.04%	645	1,025	-1,688	-687	-826
삼성 SDI	364,000	0.55	138.2	96.5	15,026	1,456	-0.13%	-319	527	-208	1,400	-2,762
NAVER	268,000	1.32	172.5	77.2	44,136	-1,993	-0.01%	750	1,354	-2,139	-2,391	2,100
LG 이노텍	174,500	1.75	43.7	74.2	18,261	2,494	-0.02%	-852	670	213	-346	-1,231
SK 하이닉스	85,400	1.91	292.8	68.2	185,963	31,102	0.05%	-1,154	689	528	1,451	-15,809
삼성전자	52,900	0.95	761.6	67.7	1,660,663	-32,434	0.02%	-18,695	6,272	11,979	-9,883	24,218
카카오	267,000	-0.37	103.1	61.6	30,849	403	-0.17%	312	336	-648	2,680	-3,501
호텔신라	70,800	8.42	141.6	60.1	17,876	165	-0.25%	-2,672	1,334	1,263	-4,302	-3,187
엔씨소프트	888,000	0.00	50.5	58.5	2,578	49	-0.19%	115	-19	-101	32	-90
삼성전기	129,000	0.39	31.0	52.4	21,241	776	-0.14%	544	-83	-469	-382	-537

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터