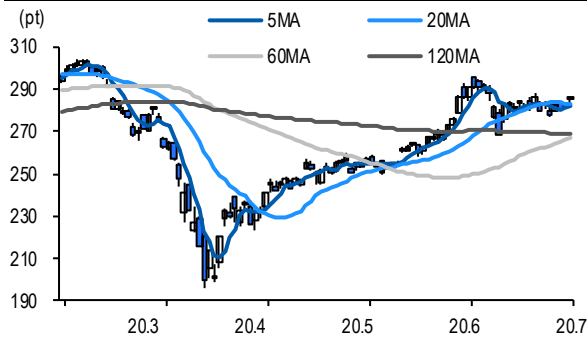


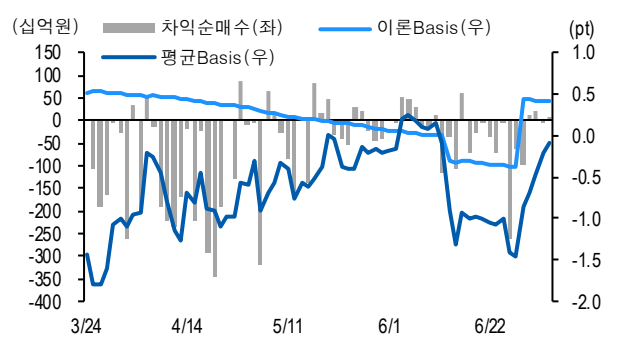


선물옵션시장 지표 2020.7.6

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	285.89	0.72	2.03	5,501.3	-
선물 9월물	286.50	1.09	3.10	14,751.8	292,945
선물 12월물	285.25	1.12	3.15	58.9	38,958
7월물(mini)	286.44	1.04	2.94	1,680.6	81,953
8월물(mini)	286.12	1.10	3.12	6.2	16,493

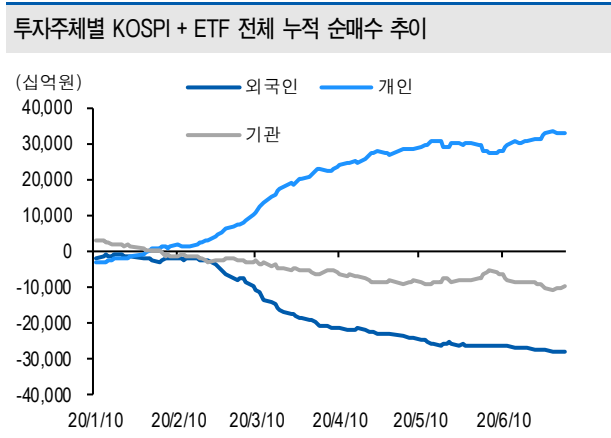


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.43	-0.09	0.61	-0.18%
베이스스(mini)	0.04	0.07	0.55	0.01%
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.75	-0.70	-0.23%
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	0.63	0.63	0.21%

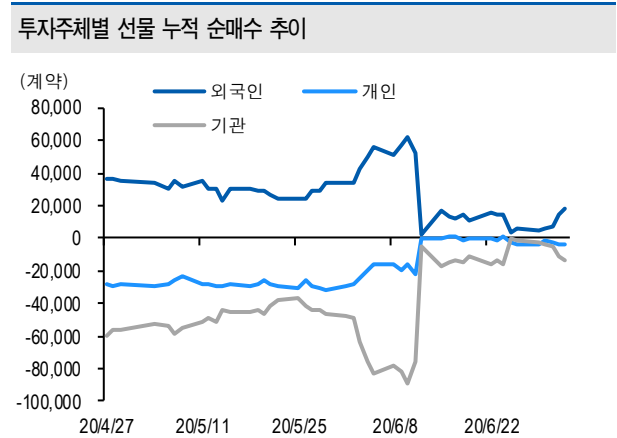


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	11.9	-8.7	3.2	0.0	75.3	108.6	77.4	5.7	-3.2	-15.4
개인	-88.4	1.0	-87.4	0.0	-0.2	-16.4	-0.2	-5.4	0.5	8.9
기관	106.8	8.7	115.5	10.0	-34.6	-89.6	-76.9	-0.4	2.9	3.8
금융투자	99.9	135.2	235.1	0.0	1.7	-103.5	-77.4	0.0	3.1	31.4
투신	-38.2	-96.9	-135.2	2.8	-20.1	43.4	0.6	-0.4	-0.1	17.3
은행+보험+기타금융	-19.5	-19.9	-39.4	0.0	-16.9	-14.4	0.0	0.0	0.0	-3.5
연기금+국가지자체	77.0	-8.7	68.3	7.1	9.4	-15.2	0.0	0.0	0.0	-41.4
기타법인	-30.3	-1.0	-31.3	0.0	0.1	-2.5	-0.4	0.1	-0.2	2.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





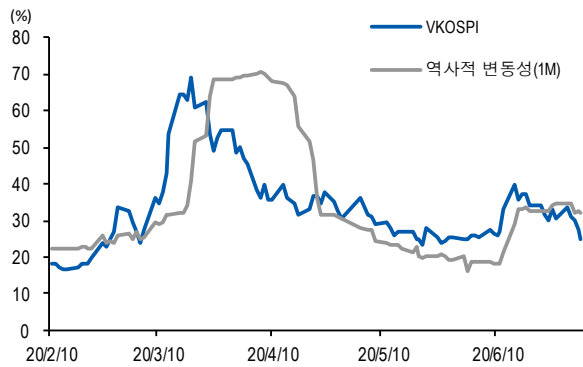
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,031,936	288.1	830,632	21.2%	지수옵션 전체	2,100,651	524.8	2,213,859
Put	1,068,715	236.7	1,383,227	22.4%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	24.78%(-2.67%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	292.5(K+3)	0.99	0.07	165,082	20,328	-505	20.5	Put	287.5(K+1)	3.77	-2.45	4,669	4,371	526	18.4
	290.0(K+2)	1.69	0.19	166,333	18,581	550	21.0		285.0(K+0)	2.63	-2.17	30,790	7,984	2,612	19.5
	287.5(K+1)	2.72	0.47	112,486	13,416	-298	21.8		282.5(K-1)	1.83	-1.82	54,467	11,293	3,518	20.8
	285.0(K+0)	4.15	0.85	63,215	10,879	-4,596	23.2		280.0(K-2)	1.22	-1.55	89,742	14,921	3,990	21.7
	282.5(K-1)	5.80	1.10	8,175	6,204	-420	24.5		277.5(K-3)	0.87	-1.20	93,040	13,779	4,997	23.3

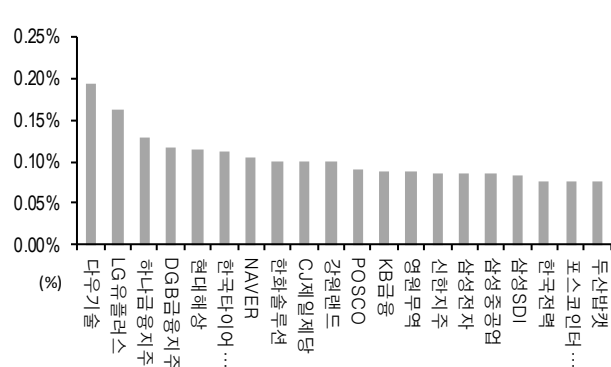
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,554,913	2,323.6	5,070,970	59,980	3,502	10,015	-20,824	-15.4	8.9	3.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	175,500	0.86	18.0	93.7	20,669	104	-0.07%	1,519	213	-1,732	-323	-1,174
삼성전자	53,700	1.32	490.3	77.4	1,465,291	-2,419	0.09%	8,457	2,685	-11,906	32,752	-57,140
카카오	295,000	3.33	345.1	73.6	44,482	1,247	0.07%	-1,611	-1,365	2,965	1,484	95
NAVER	278,500	0.36	174.6	64.7	49,418	2,187	0.11%	-1,188	-1,048	2,209	1,128	-1,135
삼성 SDI	381,500	2.55	132.1	64.1	20,148	1,777	0.08%	-137	846	-925	196	-2,331
KB 금융	34,800	0.87	21.4	59.6	114,978	7,123	0.09%	-1,124	4,523	-3,400	300	-3,121
LG 전자	65,000	0.62	19.0	59.4	27,465	-2,399	0.01%	840	-1,587	183	-454	556
현대차	99,400	-0.20	32.8	58.0	70,288	-4,879	-0.01%	-1,111	-236	1,338	1,654	3,251
SK 하이닉스	85,300	0.47	105.4	56.5	139,118	1,656	0.01%	-909	2,375	-1,509	-508	-2,099
SK 텔레콤	222,000	-1.55	35.8	56.4	12,791	-1,713	0.02%	-1,766	437	1,333	-372	2,423

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터