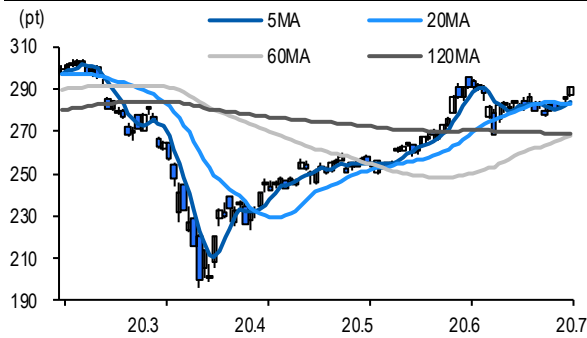


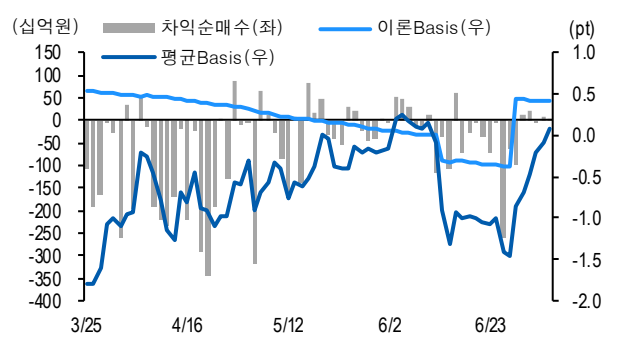


선물옵션시장 지표 2020.7

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	290.62	1.65	4.73	6,571.4	-
선물 9월물	290.70	1.47	4.20	17,002.0	294,149
선물 12월물	289.80	1.60	4.55	10.2	38,461
7월물(mini)	290.46	1.40	4.02	2,056.3	98,888
8월물(mini)	290.70	1.60	4.58	38.2	16,953

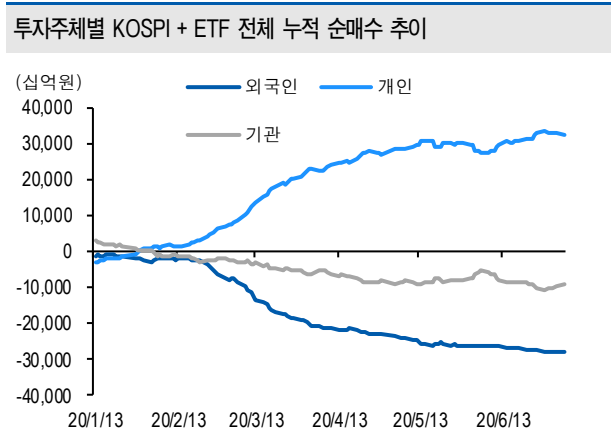


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.42	0.07	0.08	-0.12%	
베이스스(mini)	0.02	0.15	-0.16	0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.68	-0.65	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	-0.20	-0.20	-0.08%	

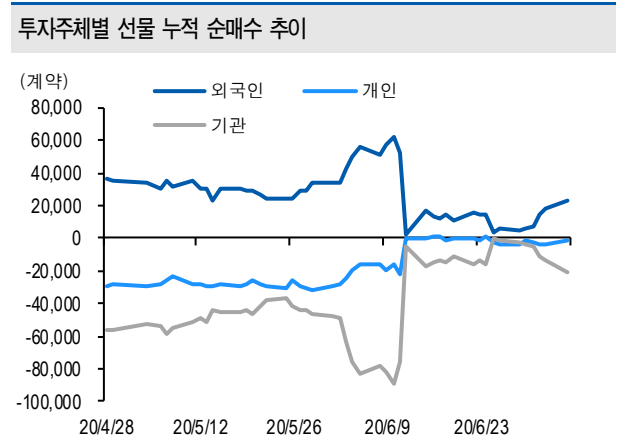


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-258.0	-19.0	-277.1	0.0	-141.5	9.8	376.8	0.4	0.0	-1.3
개인	-360.9	24.2	-336.7	0.0	-0.3	171.7	11.4	6.2	-2.3	55.9
기관	623.8	-7.3	616.5	2.5	-27.5	-154.3	-387.8	-4.8	4.2	-56.6
금융투자	562.9	121.0	684.0	0.0	-1.5	-374.5	-388.5	-3.7	4.4	-82.6
투신	-6.2	-7.9	-14.2	2.9	-14.7	157.8	0.8	-1.1	-0.2	25.8
은행+보험+기타금융	3.3	-56.2	-52.8	0.0	-17.8	79.0	0.0	0.0	0.0	-0.3
연기금+국가지자체	50.0	-65.6	-15.6	-0.4	0.6	-16.7	-0.1	0.0	0.0	0.6
기타법인	-4.8	2.1	-2.8	0.0	0.1	-27.3	-0.4	-1.9	-1.9	1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





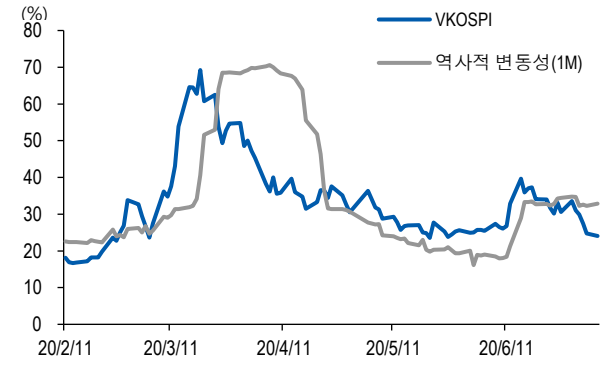
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,599,352	426.6	871,052	23.2%	지수옵션 전체	2,780,364	652.4	2,324,487
Put	1,181,012	225.8	1,453,435	27.6%	PCR(금액기준)	0.53	VKOSPI	24.02%(-0.76%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	292.5(K+3)	1.98	0.99	186,918	20,125	-203	23.1	Put	287.5(K+1)	1.71	-2.06	80,682	9,437	5,066	25.1
	290.0(K+2)	3.09	1.40	177,541	19,235	654	22.7		285.0(K+0)	1.09	-1.54	119,328	14,121	6,137	26.1
	287.5(K+1)	4.65	1.93	74,997	12,542	-874	23.2		282.5(K-1)	0.67	-1.16	115,854	15,691	4,398	27.0
	285.0(K+0)	6.51	2.36	28,932	11,538	659	23.6		280.0(K-2)	0.41	-0.81	126,068	21,432	6,511	28.1
	282.5(K-1)	8.71	2.91	2,766	5,887	-317	25.5		277.5(K-3)	0.25	-0.62	114,499	19,033	5,254	29.3

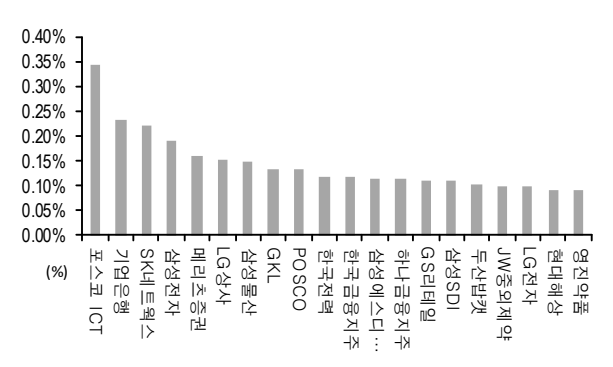
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,176,607	2,459.5	5,331,021	260,051	4,698	91,572	-99,667	-1.3	55.9	-56.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	178,500	1.71	23.2	96.0	19,227	-1,442	-0.14%	534	334	-890	-285	559
삼성전자	55,200	2.79	714.6	66.2	1,506,614	41,323	0.19%	-23,697	42,766	-19,990	-67,340	-26,283
LG 전자	68,600	5.54	63.9	64.7	42,152	14,687	0.10%	224	9,470	-12,311	-9,856	-4,520
NAVER	281,500	1.08	213.7	62.4	47,244	-2,174	0.06%	-228	1,531	-1,299	-6,731	5,847
엔씨소프트	993,000	4.86	76.8	56.7	2,146	-170	-0.08%	-201	-268	468	266	225
삼성 SDI	388,500	1.83	112.1	56.5	19,440	-708	0.11%	549	-593	78	-224	-951
SK 하이닉스	86,400	1.29	120.1	54.6	140,408	1,290	0.07%	3,059	4,534	-7,631	-2,361	-6,300
카카오	301,000	2.03	217.0	53.6	40,716	-3,766	0.01%	-875	664	370	-2,048	3,497
호텔신라	70,800	-0.14	9.9	51.0	17,535	-1,493	-0.15%	138	814	-948	-948	417
대림산업	85,000	0.35	4.2	46.7	10,626	548	0.01%	113	339	-447	-457	6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터