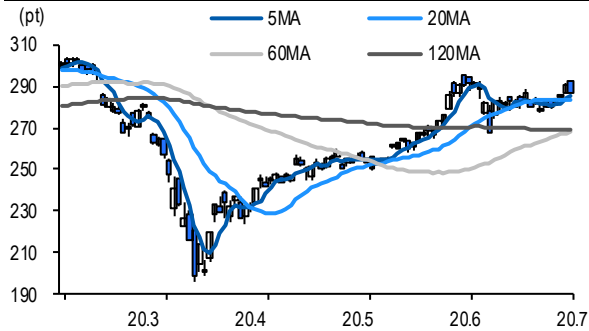


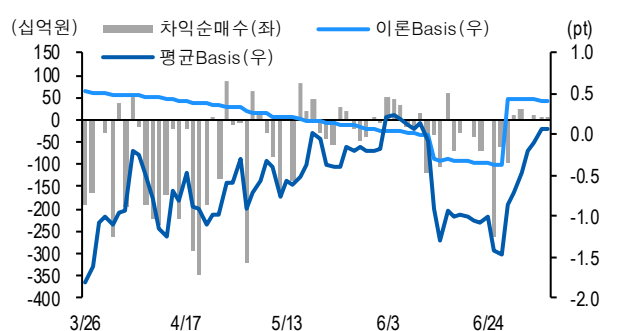


선물옵션시장 지표 2020.7.8

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	286.77	-1.32	-3.85	7,963.9	-
선물 9월물	287.50	-1.10	-3.20	23,053.9	296,264
선물 12월물	286.35	-1.19	-3.45	19.9	37,758
7월물(mini)	287.42	-1.05	-3.04	1,652.0	91,972
8월물(mini)	287.10	-1.24	-3.60	131.9	16,286

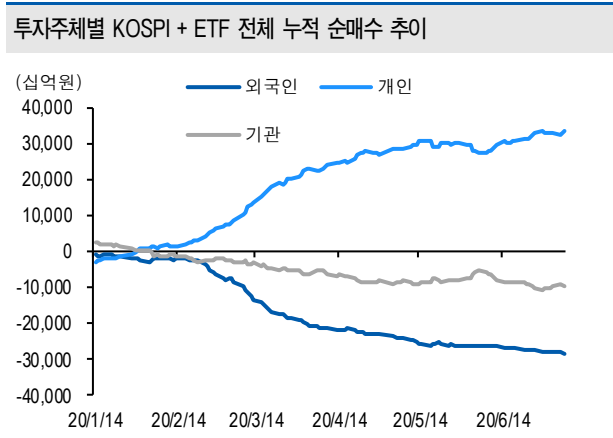


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.40	0.06	0.73	-0.12%	
베이스스(mini)	0.01	0.04	0.65	0.01%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.69	-0.65	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.52	0.52	0.18%	

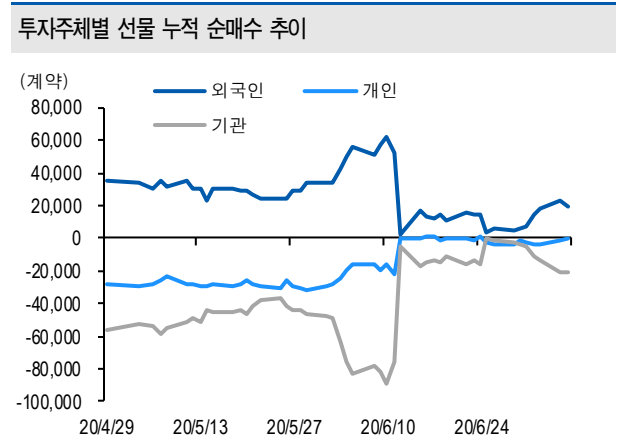


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-391.8	14.5	-377.3	0.0	-251.9	-183.7	-51.1	4.4	0.4	16.4
개인	856.8	-37.7	819.1	0.0	-0.1	155.7	-1.9	-3.5	-0.4	-30.1
기관	-464.4	23.2	-441.2	0.1	-116.5	-23.5	53.8	1.4	1.3	18.0
금융투자	-105.8	37.0	-68.8	4.4	8.4	394.6	53.5	1.3	1.0	-14.0
투신	-78.8	19.1	-59.7	0.0	-33.6	-421.2	0.3	-0.1	0.3	-72.4
은행+보험+기타금융	-35.9	-42.4	-78.4	0.0	-13.6	1.9	0.0	0.2	0.0	-3.0
연기금+국가지자체	-205.1	-7.4	-212.5	-4.3	-75.2	1.2	0.0	0.0	0.0	107.4
기타법인	-0.6	0.0	-0.6	0.0	0.0	51.5	-0.7	-2.3	-1.3	-4.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	1,572,680	312.6	904,525	23.1%	지수옵션 전체	3,274,116	665.4	2,390,584		
Put	1,701,436	352.8	1,486,059	20.2%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	24.85%(+0.83%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	0.09	-0.67	237,474	29,941	6,400	22.7	Put	292.5(K+1)	5.74	1.73	34,897	3,397	1,199	11.2
	295.0(K+2)	0.24	-1.00	255,856	32,855	6,240	22.9		290.0(K+0)	3.85	1.16	125,137	9,536	2,180	17.3
	292.5(K+1)	0.54	-1.44	189,227	23,748	3,623	22.7		287.5(K-1)	2.32	0.61	193,677	12,937	3,500	18.7
	290.0(K+0)	1.14	-1.95	143,313	18,589	-646	23.1		285.0(K-2)	1.33	0.24	247,986	17,355	3,234	20.4
	287.5(K-1)	2.21	-2.44	45,984	13,065	523	24.6		282.5(K-3)	0.75	0.08	180,813	17,185	1,494	22.2

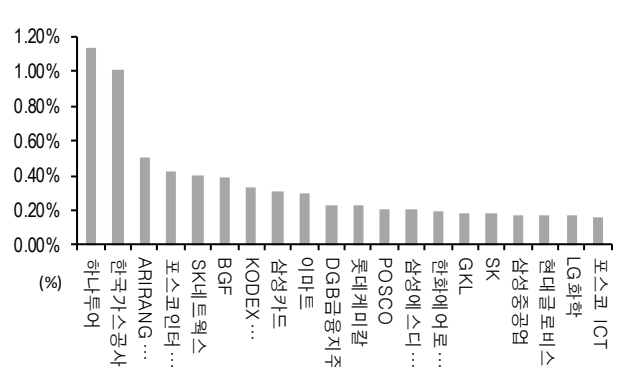
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,422,736	4,176.2	5,000,192	-330,829	23,601	-35,929	18,996	16.4	-30.1	18.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	65,100	-5.10	109.9	95.3	24,085	-18,067	-0.05%	-641	-9,595	13,787	8,530	9,470
LG 이노텍	175,000	-1.96	21.7	93.0	14,164	-5,063	-0.18%	299	-184	-115	-254	919
NAVER	280,500	-0.36	308.2	79.7	41,586	-5,658	0.06%	533	-1,036	456	28	1,201
삼성전자	53,400	-3.26	1,254.6	75.7	974,286	-532,328	-0.10%	45,047	-29,590	-11,250	41,525	147,249
삼성 SDI	391,500	0.77	223.0	73.4	23,044	3,604	0.09%	-1,544	826	693	-764	-1,748
카카오	311,000	3.32	331.8	68.8	29,148	-11,568	0.02%	-208	-1,364	1,542	-1,677	2,572
SK 하이닉스	84,300	-2.43	173.6	63.6	97,175	-43,233	-0.08%	166	1,167	-1,186	5,929	19,066
KB 금융	35,750	0.00	33.3	50.9	85,549	-13,005	0.05%	-2,429	-282	2,741	1,243	1,551
신한지주	30,150	-0.50	22.5	47.3	53,209	-37,455	0.09%	2,515	-194	-2,266	-407	-760
LG 화학	513,000	0.79	155.1	47.2	37,576	2,657	0.17%	-736	703	174	-3,357	-1,099

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터