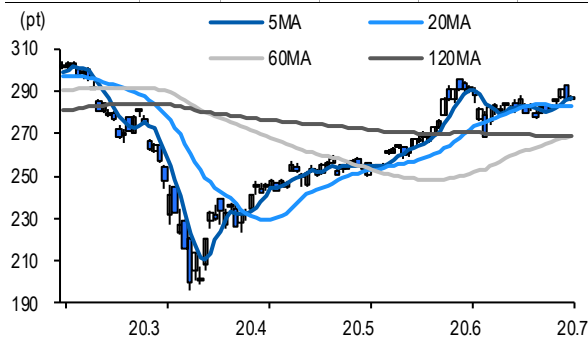


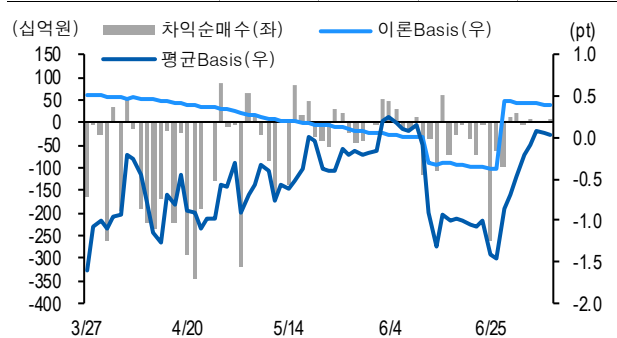
선물옵션시장 지표

2020.7.9

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	285.97	-0.28	-0.80	6,472.9	-
선물 9월물	286.15	-0.47	-1.35	20,552.2	291,387
선물 12월물	285.55	-0.28	-0.80	18.4	37,771
7월물(mini)	286.08	-0.47	-1.34	1,571.4	77,267
8월물(mini)	286.18	-0.32	-0.92	201.7	19,792



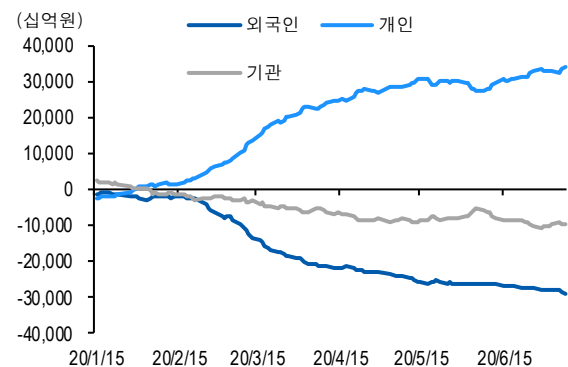
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.40	0.03	0.18	-0.13%
베이스스(mini)	0.01	0.02	0.11	0.00%
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.68	-0.65	-0.21%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.20	0.20	0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-343.6	4.3	-339.2	0.0	-236.8	48.6	-109.0	4.3	4.7	14.1
개인	623.5	-65.0	558.5	0.0	-1.7	37.4	2.7	-1.9	-1.5	-1.3
기관	-275.9	61.1	-214.8	8.7	-22.5	-74.4	105.9	0.8	-1.3	-14.7
금융투자	-140.0	69.9	-70.0	0.0	0.6	72.4	105.8	2.9	-1.0	30.2
투신	-72.4	-5.8	-78.3	0.0	-13.3	-85.5	0.1	-2.2	0.0	-26.6
은행+보험+기타금융	-26.8	7.3	-19.5	0.0	-1.5	-29.4	0.0	0.1	-0.2	-2.8
연기금+국가지자체	12.5	-15.5	-3.0	8.7	-6.2	-31.9	0.1	0.0	0.0	-15.5
기타법인	-4.0	-0.4	-4.5	0.0	0.1	-11.7	0.4	-3.2	-2.0	1.9

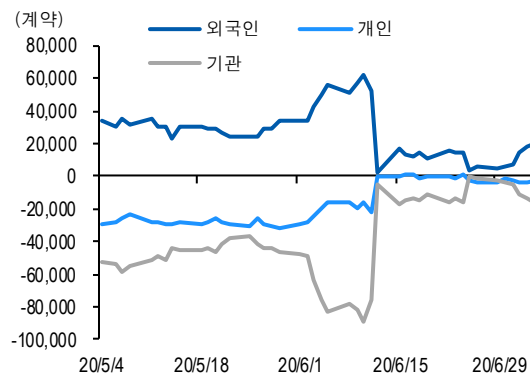
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



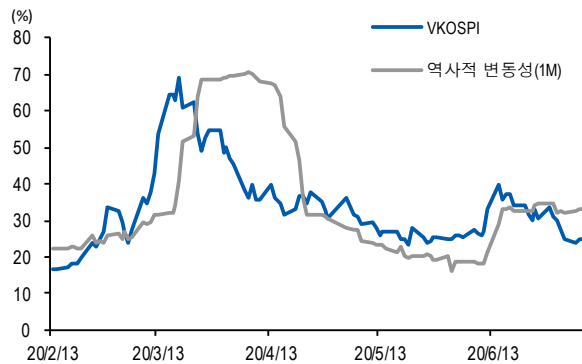
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,664,980	292.0	945,221	21.4%	지수옵션 전체	3,327,995	626.5	2,485,203
Put	1,663,015	334.5	1,539,982	21.7%	PCR(금액기준)	1.15	VKOSPI	25.04%(+0.19%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	295.0(K+3)	0.04	-0.20	312,689	36,461	3,606	21.1	Put	290.0(K+1)	4.27	0.42	40,027	9,999	463	17.2
	292.5(K+2)	0.15	-0.39	331,878	31,680	7,932	21.1		287.5(K+0)	2.48	0.16	156,643	12,495	-442	19.0
	290.0(K+1)	0.45	-0.69	346,548	31,479	12,890	21.0		285.0(K-1)	1.28	-0.05	240,101	18,513	1,158	20.5
	287.5(K+0)	1.15	-1.06	249,762	18,398	5,333	21.4		282.5(K-2)	0.57	-0.18	294,025	18,767	1,582	21.4
	285.0(K-1)	2.39	-1.35	92,293	14,154	3,564	22.0		280.0(K-3)	0.27	-0.13	272,678	25,429	2,910	23.6

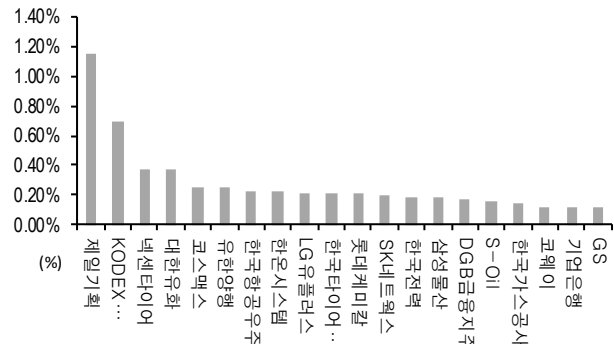
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,368,867	3,368.6	5,052,135	51,943	50,010	8,260	-58,891	14.1	-1.3	-14.7		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	25,550	-2.11	12.3	156.2	28,081	-15,931	-0.29%	3,481	-3,612	139	-241	395
LG 이노텍	174,000	-0.57	46.6	143.7	6,089	-8,075	-0.32%	197	-42	-155	1,681	3,071
대림산업	83,300	-1.77	13.4	106.6	4,790	-5,188	0.02%	70	1,187	-1,258	-1,499	243
삼성 SDI	383,000	-2.17	166.3	85.8	19,394	-3,650	0.03%	-148	367	-249	-1,886	2,166
LG 전자	66,600	2.30	52.7	71.0	15,002	-9,083	-0.04%	493	-4,409	3,922	1,195	2,980
NAVER	282,500	0.71	257.9	68.4	34,030	-7,556	-0.03%	1,210	-204	-1,029	-1,318	1,815
삼성전자	53,000	-0.75	648.9	62.5	687,435	-286,851	-0.01%	7,387	-2,406	-5,061	64,359	-63,892
삼성전기	128,000	1.19	24.5	60.2	13,653	-4,259	-0.04%	590	657	-1,257	219	-320
카카오	328,000	5.47	355.6	60.1	24,756	-4,392	-0.03%	193	-3,039	2,853	-365	1,986
현대차	98,000	-1.41	50.6	59.1	34,956	-17,284	-0.11%	-251	2,503	-2,264	-761	-1,468

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터