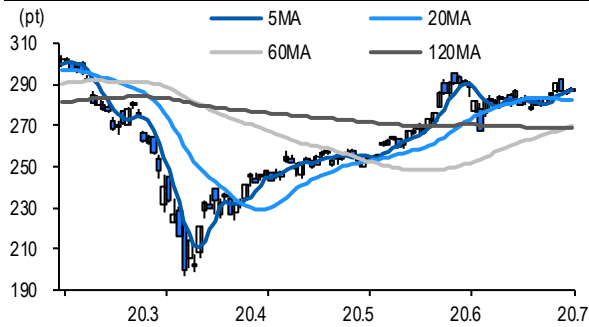


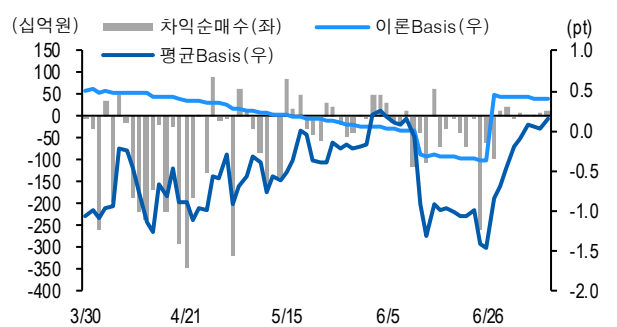


선물옵션시장 지표 2020.7.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	287.25	0.45	1.28	7,801.5	-
선물 9월물	288.00	0.65	1.85	19,653.8	289,222
선물 12월물	287.15	0.56	1.60	26.2	37,815
7월물(mini)	287.68	0.56	1.60	989.4	0
8월물(mini)	287.86	0.59	1.68	773.1	30,821

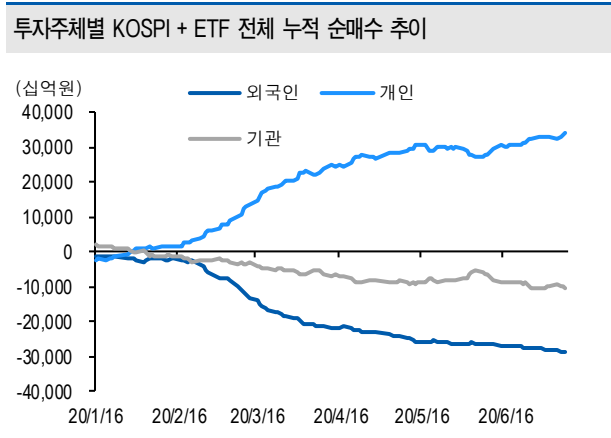


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.39	0.16	0.75	-0.08%	
베이스스(mini)	0.00	0.02	0.43	0.01%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.65	-0.65	-0.20%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	0.59	0.59	0.21%	

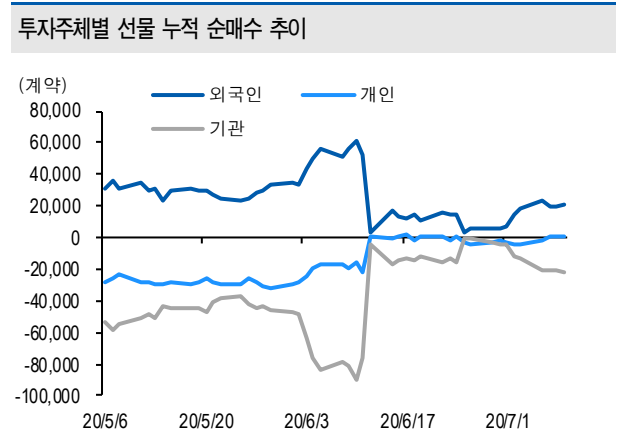


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-32.8	-0.1	-32.9	2.0	52.1	270.8	-134.8	1.7	-0.8	4.8
개인	317.7	-46.7	271.0	0.0	-0.4	-11.5	3.0	7.6	1.8	24.1
기관	-259.8	55.5	-204.2	10.1	-91.7	-262.7	131.2	-7.4	0.6	-30.9
금융투자	-163.6	74.2	-89.4	0.0	-65.5	-446.7	131.1	-0.4	0.5	6.7
투신	-13.5	-5.9	-19.5	-0.2	-18.4	169.4	0.0	-5.2	0.1	1.7
은행+보험+기타금융	-2.9	15.7	12.7	0.0	-4.3	30.6	0.0	-1.5	0.0	1.1
연기금+국가자자체	-63.7	-36.5	-100.2	10.3	6.3	-16.1	0.2	-0.3	0.1	-40.4
기타법인	-25.2	-8.7	-33.9	0.0	-0.1	3.5	0.6	-1.9	-1.6	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





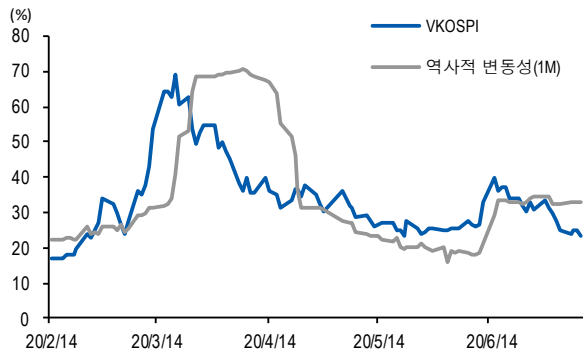
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,871,949	340.2	484,279	15.6%	지수옵션 전체	3,501,004	574.3	1,246,182
Put	1,629,055	234.0	761,903	10.2%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	23.38%(-1.66%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	292.5(K+3)	0.02	-0.13	417,373	0	-31,680	17.0	Put	287.5(K+1)	0.37	-2.11	474,236	0	-12,495	3.8
	290.0(K+2)	0.08	-0.37	680,781	0	-31,479	13.3		285.0(K+0)	0.03	-1.25	404,672	0	-18,513	9.2
	287.5(K+1)	0.69	-0.46	371,995	0	-18,398	13.4		282.5(K-1)	0.01	-0.56	227,877	0	-18,767	14.4
	285.0(K+0)	2.87	0.48	94,695	0	-14,154	24.7		280.0(K-2)	0.01	-0.26	93,821	0	-25,429	20.9
	282.5(K-1)	5.32	1.08	4,929	0	-6,058	36.3		277.5(K-3)	0.01	-0.10	49,534	0	-23,301	27.2

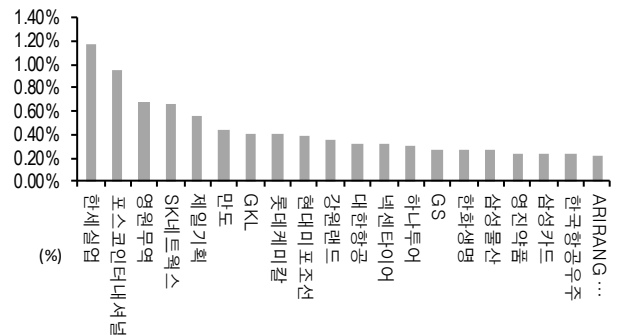
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,391,905	3,609.9	3,795,819	-1,256,316	-39,234	85,482	-49,319	4.8	24.1	-30.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KODEX												
삼성그룹	7,175	0.21	0.8	81.5	218	113	-0.10%	0	0	0	0	0
삼성전기	127,000	-0.78	17.7	34.6	0	-13,653	0.19%	1,742	-10	-1,746	-1,014	-1,651
두산인프라코어	6,390	-1.54	7.2	31.8	0	-254,198	0.08%	-7,574	-7,732	15,306	9,078	7,356
대한항공	17,100	3.01	5.2	31.5	0	-61,358	0.33%	2,846	2,038	-4,894	-2,501	-141
LG 이노텍	178,500	2.59	9.1	30.3	0	-6,089	-0.30%	362	755	-1,133	-1,966	-12
롯데쇼핑	80,500	-0.98	2.0	25.5	0	-5,170	-0.17%	-380	41	335	-151	800
카카오	356,000	8.54	215.4	25.5	0	-24,756	-0.09%	-902	-7,062	8,039	1,345	8,017
GS 건설	26,100	2.15	2.7	23.8	0	-28,081	-0.28%	-324	1,766	-1,442	-1,580	223
아모레퍼시픽	159,500	-1.85	11.3	23.2	0	-16,610	0.03%	-383	119	254	744	1,045
삼성전자	52,900	-0.19	202.5	22.7	0	-687,435	-0.02%	-7,489	5,550	1,488	71,539	-65,593

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

