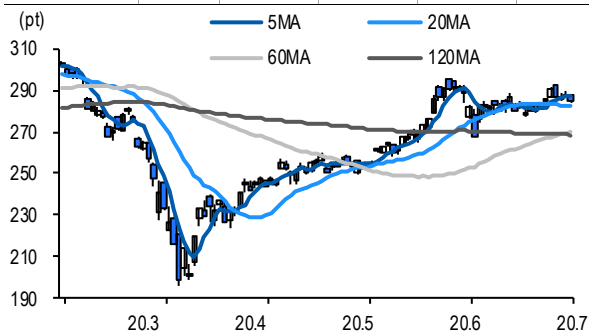


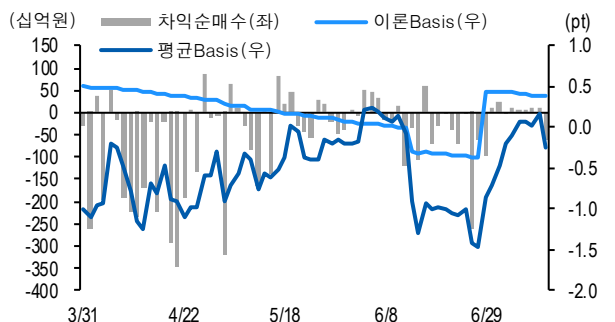
선물옵션시장 지표

2020.7.13

Market Data	(십억원, 계약)				
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	285.06	-0.76	-2.19	7,157.8	-
선물 9월물	284.55	-1.20	-3.45	18,617.6	288,996
선물 12월물	283.80	-1.17	-3.35	22.3	37,862
8월물(mini)	284.62	-1.13	-3.24	1,535.3	39,844
9월물(mini)	284.40	-1.25	-3.50	155.3	17,831



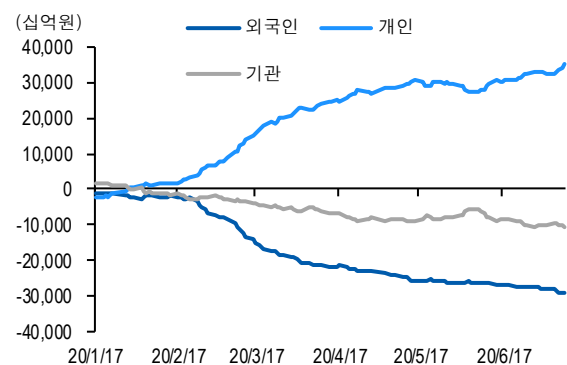
차익거래 관련 Market data	(pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.38	-0.26	-0.51	-0.23%	
베이스스(mini)	0.21	-0.10	-0.44	-0.11%	
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.69	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.21	-0.50	-0.50	-0.25%	



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-344.2	22.0	-322.2	0.0	-180.0	189.4	-348.3	7.3	-0.7	-21.3
개인	1,037.3	16.9	1,054.3	0.0	-2.4	-291.7	6.7	-4.8	2.4	-10.7
기관	-708.4	-35.5	-743.9	-61.2	-50.1	102.7	341.4	-1.6	-1.1	31.8
금융투자	-446.7	-64.4	-511.1	0.0	-18.3	375.1	341.5	2.9	2.8	14.9
투신	-65.4	-1.1	-66.5	0.0	-12.0	-316.6	0.0	-4.3	-3.4	-38.8
은행+보험+기타금융	-13.2	24.8	11.6	0.0	-14.3	-14.1	0.0	-0.2	-0.6	6.0
연기금+국가지자체	-137.7	-0.8	-138.5	-61.2	-2.7	58.3	0.0	0.0	0.0	49.8
기타법인	15.3	-3.4	11.8	0.0	-0.3	-0.4	0.1	-0.9	-0.6	0.2

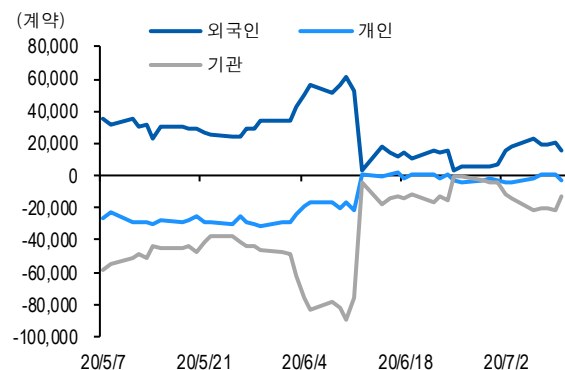
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	423,732	197.4	528,832	19.5%	지수옵션 전체	1,009,158	462.9	1,371,471
Put	585,426	265.5	842,639	23.0%	PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI	24.83%(+1.45%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	295.0(K+3)	3.13	-1.03	23,096	6,535	1,424	19.4	Put	290.0(K+1)	10.25	1.71	2,829	1,444	459	21.6
	292.5(K+2)	3.89	-1.32	15,448	4,222	1,134	19.4		287.5(K+0)	8.94	1.57	6,594	3,934	1,587	22.0
	290.0(K+1)	4.88	-1.39	13,623	6,049	957	19.7		285.0(K-1)	7.69	1.40	6,944	4,967	1,202	22.2
	287.5(K+0)	6.00	-1.30	15,117	6,636	4,999	20.0		282.5(K-2)	6.72	1.64	9,147	2,680	564	22.9
	285.0(K-1)	7.31	-1.87	4,903	2,872	1,090	20.4		280.0(K-3)	5.78	1.48	12,614	4,896	-144	23.4

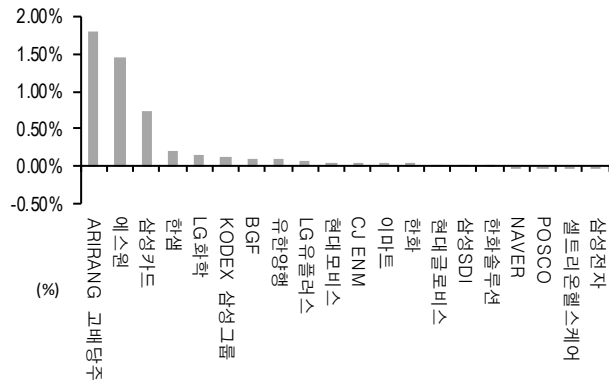
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,725,538	2,582.0	3,981,935	186,116	-20,003	-3,334	23,905	-21.3	-10.7	31.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	176,500	-2.22	27.7	123.8	10,608	-43	-0.33%	383	-110	-261	1,490	-79
삼성 SDI	391,000	-0.76	118.9	78.9	23,125	-1,050	0.02%	-1,432	597	821	-437	2,129
LG 전자	68,100	0.29	36.9	69.7	28,202	6,529	-0.09%	67	2,871	-2,931	555	-5,030
엔씨소프트	942,000	-0.63	78.7	64.7	1,824	209	-0.16%	-141	-330	472	313	163
카카오	355,000	0.57	589.4	64.5	40,515	959	-0.47%	405	-276	-113	1,947	-157
대림산업	81,900	-1.68	6.2	56.8	12,566	712	-0.06%	134	783	-869	-509	-337
기아차	32,000	-1.99	19.2	56.4	24,215	2,067	-0.27%	302	-406	76	3,191	1,534
NAVER	299,000	3.64	350.7	55.3	42,750	-3,798	0.00%	-1,277	-2,201	3,437	-2,987	8,183
삼성전기	125,000	-1.96	25.1	54.8	18,137	306	-0.50%	-795	-1,085	1,876	2,066	780
삼성전자	52,800	-0.94	381.0	52.9	1,091,905	-2,843	-0.01%	-15,989	-7,781	23,617	-3,924	28,584

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터