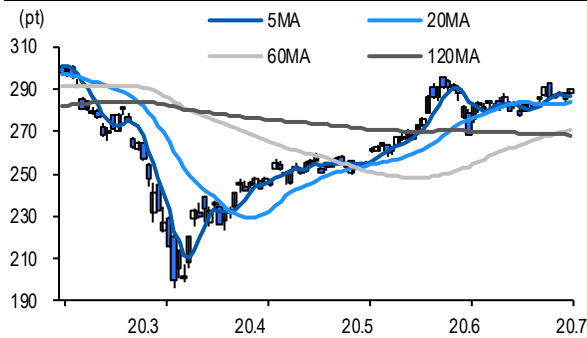


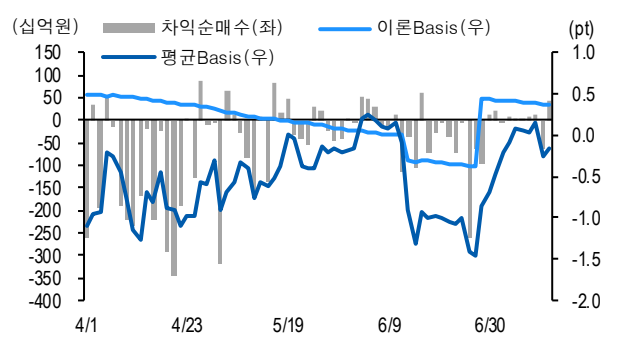
선물옵션시장 지표

2020.7.14

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	289.84	1.68	4.78	6,063.6	-
선물 9월물	289.80	1.85	5.25	13,752.9	289,257
선물 12월물	289.35	1.96	5.55	14.4	37,913
8월물(mini)	289.92	1.86	5.30	1,012.3	41,424
9월물(mini)	290.08	1.94	5.68	26.6	17,853

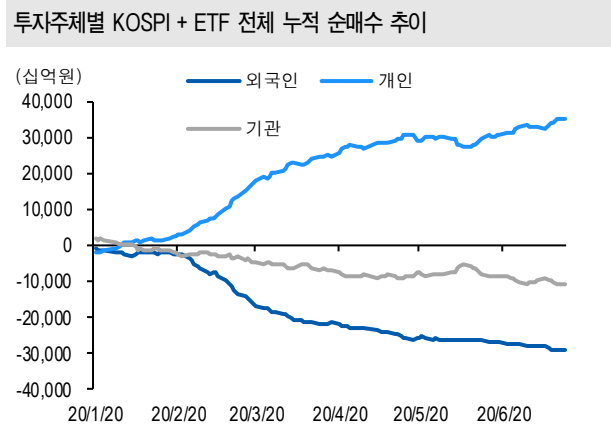


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.37	-0.15	-0.04	-0.18%	
베이스스(mini)	0.19	0.00	0.08	-0.07%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.70	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.19	0.06	0.06	-0.05%	

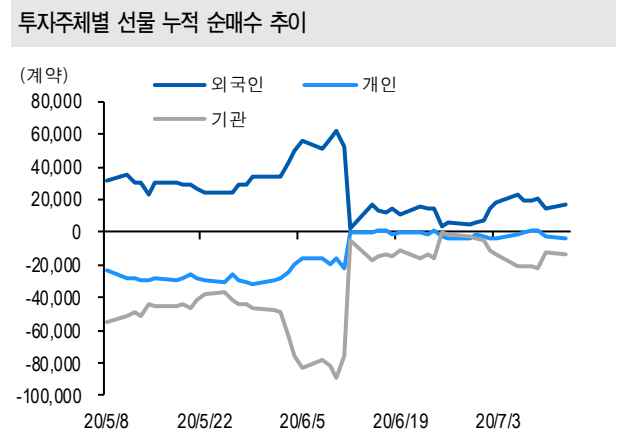


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	101.3	-8.4	92.9	0.0	176.2	80.0	54.1	-0.1	0.1	13.4	
개인	-290.5	19.3	-271.2	0.0	2.1	-8.3	-26.9	1.3	-2.1	88.2	
기관	201.2	-19.4	181.8	43.5	-12.2	-76.3	-27.8	-1.0	1.9	-103.4	
금융투자	91.8	1.8	93.7	-7.2	8.6	-498.0	-27.9	-0.9	1.9	-60.5	
투신	-6.0	-6.1	-12.1	0.0	-3.2	506.1	0.1	0.0	0.1	31.7	
은행+보험+기타금융	-7.2	-10.3	-17.6	0.0	-4.7	-28.4	0.0	0.0	-0.1	-0.5	
연기금+국가지자체	122.5	-4.9	117.5	50.7	-0.6	-56.0	0.0	0.0	0.0	-74.1	
기타법인	-12.0	8.4	-3.5	0.0	0.3	4.6	0.6	-0.2	0.1	1.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

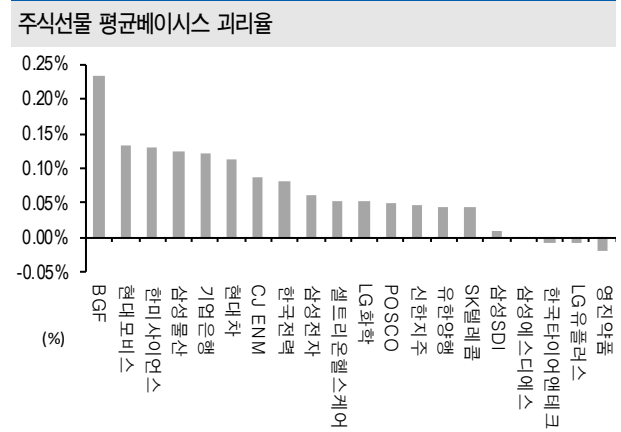
지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	463,553	181.2	557,514	20.1%	지수옵션 전체	838,363	320.5	1,442,444
Put	374,810	139.3	884,930	22.7%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	23.63%(-1.20%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	292.5(K+3)	5.71	1.82	7,989	4,310	88	20.0	Put	287.5(K+1)	6.03	-2.91	5,649	3,822	-112	21.2
	290.0(K+2)	6.99	2.11	8,510	7,800	1,751	20.4		285.0(K+0)	5.15	-2.54	8,176	5,617	650	21.8
	287.5(K+1)	8.40	2.40	3,762	6,528	-108	20.7		282.5(K-1)	4.33	-2.39	6,362	3,004	324	22.2
	285.0(K+0)	10.05	2.74	2,188	3,045	173	21.4		280.0(K-2)	3.65	-2.13	13,025	5,696	800	22.7
	282.5(K-1)	11.70	2.87	483	2,109	-24	21.7		277.5(K-3)	3.10	-1.84	10,521	4,067	1,165	23.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	2,655,593	2,149.2	4,186,449	204,514	50,054	107,166	-156,649	13.4	88.2	-103.4		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
코웨이	71,000	1.43	9.0	102.3	2,919	370	-0.18%	-212	317	-105	-216	340
삼성 SDI	394,500	0.90	151.6	93.9	21,702	-1,423	0.01%	-132	392	-326	-699	1,279
NAVER	297,500	-0.50	283.8	76.7	44,472	1,722	-0.04%	71	2,769	-2,499	-5,464	4,205
카카오	351,500	-0.99	345.4	71.0	40,909	394	-0.26%	1,187	3,128	-4,696	-1,398	-2,069
KODEX 삼성그룹	7,130	0.92	0.5	61.9	143	54	-0.32%	0	0	0	0	0
삼성전자	53,500	1.33	392.8	61.1	1,155,583	63,678	0.06%	-6,730	37,923	-31,282	-16,875	-39,094
CJ	88,100	2.20	1.7	58.2	17,238	345	-0.67%	397	253	-650	-150	0
호텔신라	69,200	0.87	9.9	57.9	15,834	1,818	-0.20%	39	557	-596	385	-2,574
LG 전자	68,600	0.73	22.1	56.5	29,413	1,211	-0.05%	564	1,287	138	-584	10
GS 건설	26,200	2.54	4.0	55.0	42,819	1,778	-0.16%	2,365	-134	-2,231	-120	-2,131

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

