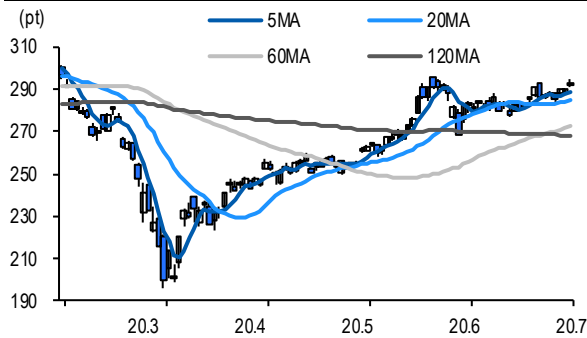


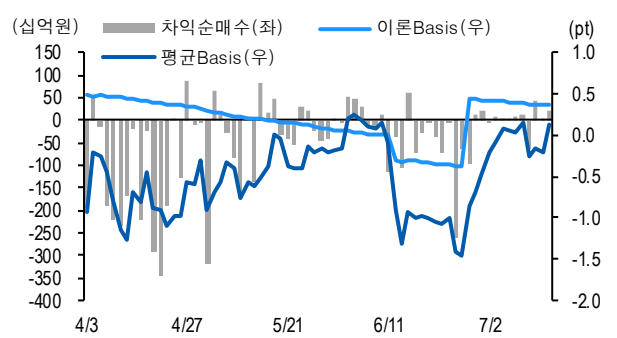


선물옵션시장 지표 2020.7.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	292.27	0.91	2.64	7,828.8	-
선물 9월물	292.55	1.11	3.20	17,014.0	292,779
선물 12월물	291.90	0.99	2.85	15.3	37,527
8월물(mini)	292.44	0.99	2.88	1,669.3	47,880
9월물(mini)	292.46	1.07	2.90	11.3	18,856

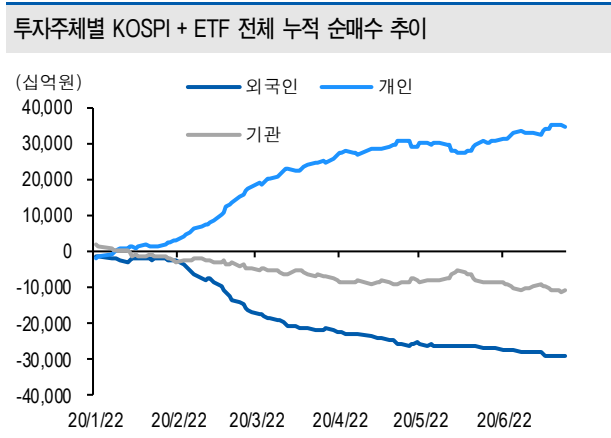


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스스	0.36	0.12	0.28	-0.08%
베이스스(mini)	0.18	0.11	0.17	-0.03%
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.70	-0.70	-0.21%
합성선물 베이스스(ATM)	0.18	0.23	0.23	0.02%

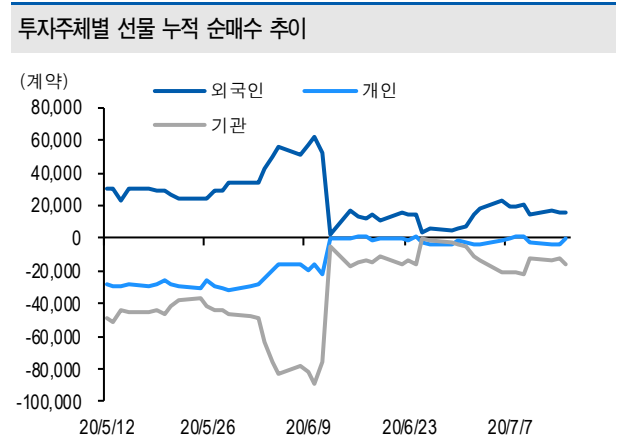


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	268.2	17.4	285.6	0.0	65.8	-328.5	346.8	0.6	0.5	17.3
개인	-600.0	-73.3	-673.3	0.0	3.0	247.7	7.9	0.9	-1.9	39.5
기관	335.7	60.7	396.4	23.5	-127.0	73.3	-354.7	-1.0	2.1	-57.0
금융투자	446.8	155.6	602.4	0.0	4.5	-52.9	-354.5	-1.1	2.1	1.9
투신	-8.2	-36.8	-45.0	0.0	2.7	150.2	-0.1	0.2	0.0	15.4
은행+보험+기타금융	-45.2	-45.5	-90.7	-1.5	-24.8	0.5	0.0	-0.1	0.0	0.6
연기금+국가자차체	-59.2	-15.0	-74.3	24.9	-107.2	-24.6	0.0	0.0	0.0	-74.9
기타법인	-3.9	-4.8	-8.7	0.0	0.3	7.5	-0.1	-0.5	-0.7	0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

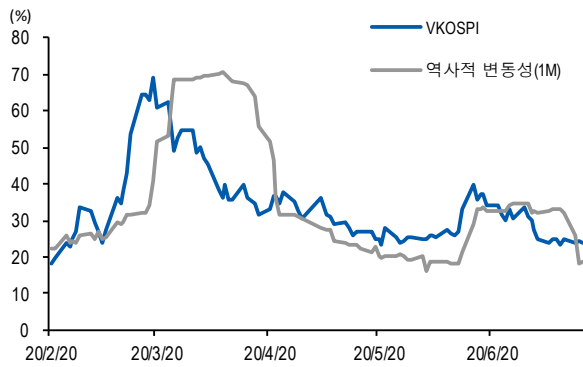
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성	지수옵션 전체	거래량	거래대금	미결제약정
Call	589,993	264.6	595,419	19.8%		1,024,261	423.4	1,540,708
Put	434,268	158.8	945,289	22.0%	PCR(금액기준)	0.60	VKOSPI	23.63%(-0.82%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	4.44	0.83	14,038	6,965	75	19.7	Put	292.5(K+1)	6.81	-1.69	4,987	2,742	1,528	20.3
	295.0(K+2)	5.55	1.00	13,133	8,391	1,694	20.1		290.0(K+0)	5.76	-1.63	6,643	4,180	734	20.8
	292.5(K+1)	6.82	1.17	4,358	4,873	125	20.5		287.5(K-1)	4.88	-1.42	6,340	4,285	328	21.4
	290.0(K+0)	8.26	1.35	3,436	7,662	-233	20.9		285.0(K-2)	4.10	-1.28	15,284	7,344	1,431	21.9
	287.5(K-1)	9.88	1.54	1,085	6,465	-8	21.5		282.5(K-3)	3.47	-1.10	11,644	3,791	260	22.5

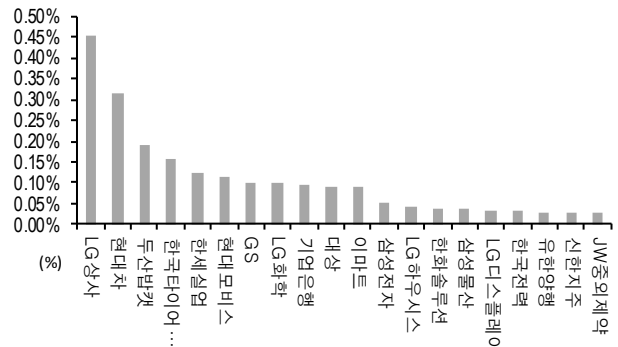
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,537,793	2,743.8	4,333,211	157,380	43,424	32,460	-75,292	17.3	39.5	-57.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	393,000	0.26	113.7	77.9	19,862	-205	0.00%	-273	-152	411	-372	742
카카오	337,500	-2.03	338.0	67.4	42,316	-1,011	-0.17%	592	2,977	-3,846	816	-1,859
NAVER	286,500	-0.69	244.7	67.1	43,141	1,307	-0.01%	3,111	1,516	-4,738	-142	-1,947
LG 이노텍	168,500	-2.60	21.1	56.8	9,048	-1,444	-0.71%	610	1,383	-1,995	595	108
대림산업	86,900	1.05	17.0	53.6	17,425	3,916	-0.01%	343	-291	-68	-489	-1,997
삼성전자	54,700	1.67	643.8	53.3	1,151,040	57,967	0.05%	29,003	15,914	-44,114	-16,739	-51,550
금호석유	88,400	5.11	25.7	52.4	3,321	-483	-0.12%	-1,731	470	1,249	468	785
현대모비스	215,500	2.62	92.7	52.4	22,761	7,328	0.11%	-92	895	-821	-437	-4,373
SK 하이닉스	83,100	0.24	117.5	47.0	104,535	1,380	-0.01%	-781	1,138	-363	-6,702	2,175
신한지주	29,800	1.02	24.9	46.2	84,469	771	0.03%	631	1,928	-2,559	1,129	-3,003

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터