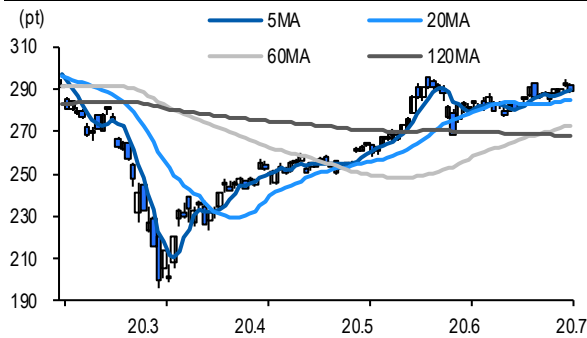
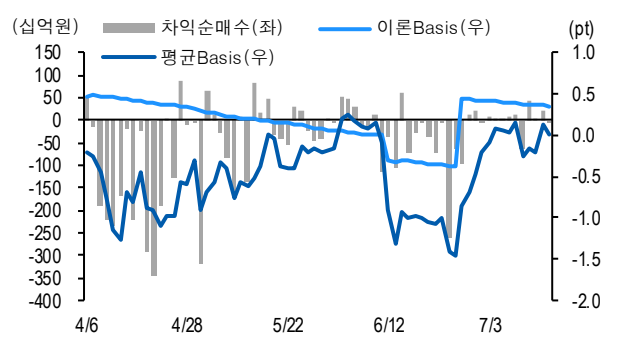


선물옵션시장 지표 2020.7.17

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	289.25	-1.03	-3.02	6,530.5	-
선물 9월물	289.20	-1.15	-3.35	16,423.5	291,896
선물 12월물	288.40	-1.20	-3.50	22.2	37,543
8월물(mini)	289.16	-1.12	-3.28	1,515.8	48,756
9월물(mini)	289.20	-1.15	-3.26	19.1	18,613

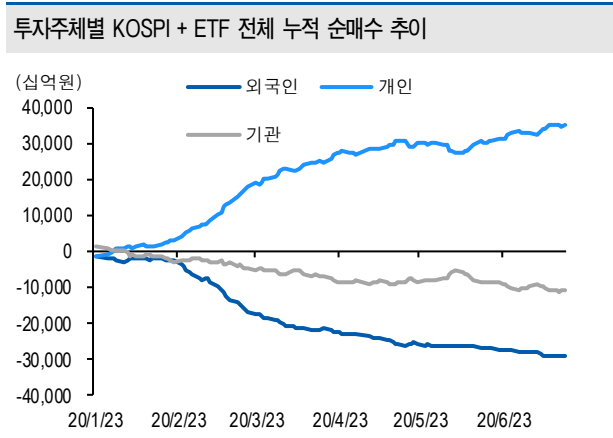


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.35	0.02	-0.05	-0.11%
베이스스(mini)	0.18	0.04	-0.09	-0.05%
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.70	-0.70	-0.21%
합성선물 베이스스(ATM)	0.18	-0.09	-0.09	-0.09%

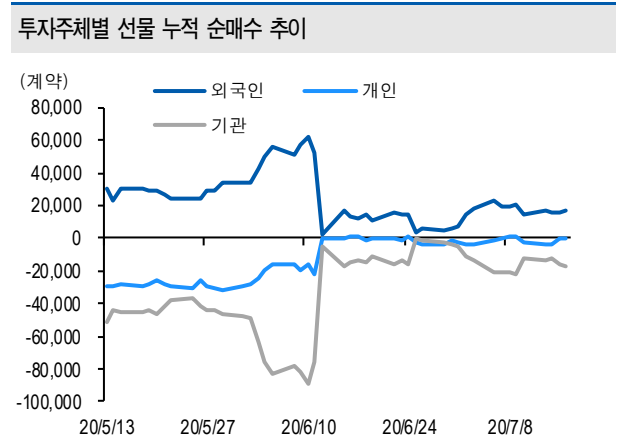


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-133.6	35.4	-98.2	0.0	-31.7	75.0	4.0	-4.7	-0.6	19.4
개인	300.6	-8.1	292.5	0.0	-0.7	-8.9	10.9	3.0	-0.9	-76.1
기관	-183.5	-35.4	-218.9	-0.1	-25.2	-56.4	-15.4	1.3	1.8	58.6
금융투자	-26.4	0.3	-26.1	0.0	10.4	315.2	-15.7	1.3	1.8	21.3
투신	-32.2	-34.7	-66.9	0.0	-14.4	-370.1	0.3	0.0	0.0	-21.9
은행+보험+기타금융	-14.2	6.0	-8.2	0.0	-10.5	-1.3	0.0	0.0	0.0	0.9
연기금+국가지자체	-97.0	-1.1	-98.1	-0.1	-11.0	-0.3	0.0	0.0	0.0	58.4
기타법인	16.6	8.1	24.7	0.0	-0.3	-9.6	0.6	0.4	-0.3	-1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

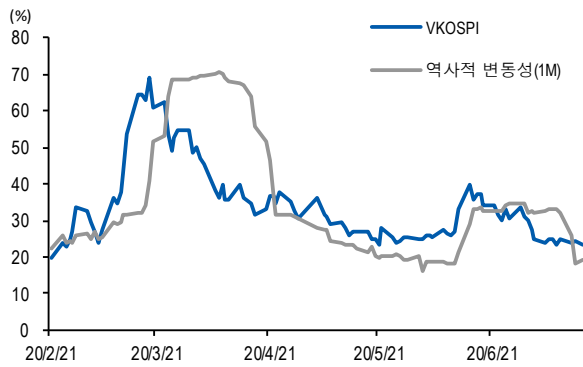
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	503,828	185.6	617,265	18.7%	지수옵션 전체	985,154	390.7	1,580,120
Put	481,326	205.1	962,855	21.2%	PCR(금액기준)	1.11	VKOSPI	23.48%(-0.15%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	2.26	-1.26	39,595	16,386	188	18.6	Put	295.0(K+1)	9.69	1.65	1,777	1,570	345	19.9
	297.5(K+2)	2.96	-1.48	19,293	7,444	479	18.7		292.5(K+0)	8.22	1.41	3,585	3,273	531	20.1
	295.0(K+1)	3.84	-1.71	14,194	9,744	1,353	19.0		290.0(K-1)	6.94	1.18	5,478	4,138	-42	20.4
	292.5(K+0)	4.88	-1.94	6,556	5,245	372	19.3		287.5(K-2)	5.86	0.98	10,046	4,587	302	20.9
	290.0(K-1)	6.10	-2.16	3,417	8,036	374	19.6		285.0(K-3)	4.92	0.82	16,744	7,186	-158	21.4

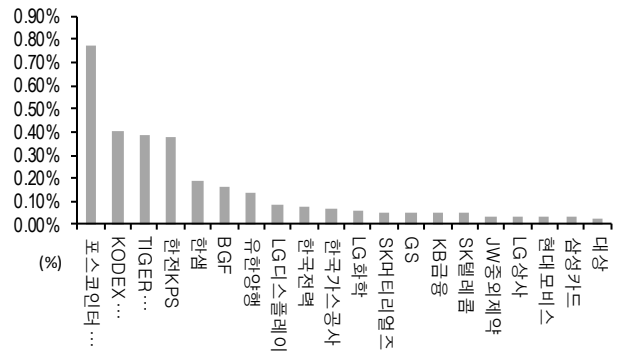
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,278,779	2,615.6	4,309,455	-23,756	30,246	-49,194	21,629	19.4	-76.1	58.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	386,500	-1.65	121.7	73.0	18,770	-1,092	0.00%	-397	-568	966	305	1,064
삼성전자	53,900	-1.46	631.8	69.5	1,144,016	-7,024	0.00%	29,535	-12,588	-16,461	-19,542	7,980
LG	73,100	-0.54	11.6	67.0	5,365	-281	-0.06%	568	-739	182	-135	348
기아차	35,250	-0.14	44.3	65.9	38,190	7,427	-0.10%	-3,783	-1,628	5,573	4,549	-3,693
LG 전자	74,500	-0.53	58.0	65.7	32,353	-2,266	-0.10%	-2,562	-148	3,198	1,172	2,435
금호석유	88,600	0.23	10.0	60.6	2,624	-697	-0.25%	14	-293	279	673	219
호텔신라	71,900	1.84	39.9	59.9	18,305	1,012	-0.13%	-1,027	633	382	1,148	-1,729
카카오	322,000	-4.59	371.4	58.8	37,460	-4,856	-0.12%	2,084	-4,577	2,657	1,387	1,088
NAVER	272,500	-4.89	203.6	54.9	33,813	-9,328	0.02%	-1,713	-7,788	9,473	5,710	4,390
대림산업	89,300	2.76	11.7	52.6	18,414	989	-0.06%	-1,361	1,389	17	-470	302

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터