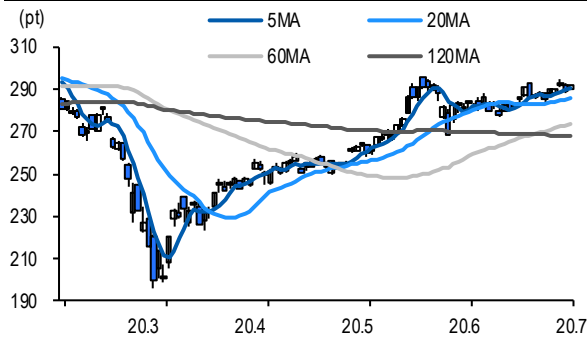


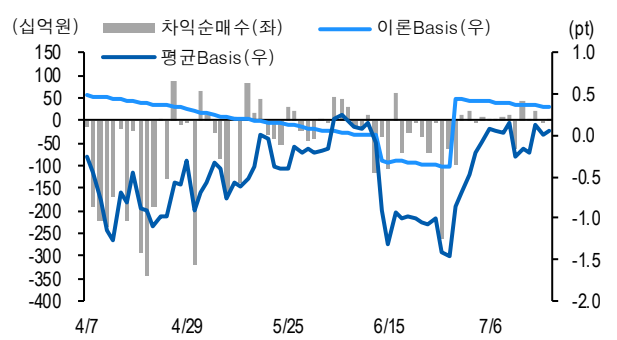


선물옵션시장 지표 2020.7.20

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	291.57	0.80	2.32	6,289.2	-	
선물 9월물	291.85	0.92	2.65	13,173.7	291,884	
선물 12월물	291.15	0.95	2.75	12.2	37,556	
8월물(mini)	291.78	0.91	2.62	1,085.5	48,643	
9월물(mini)	291.90	0.93	2.70	12.8	18,487	

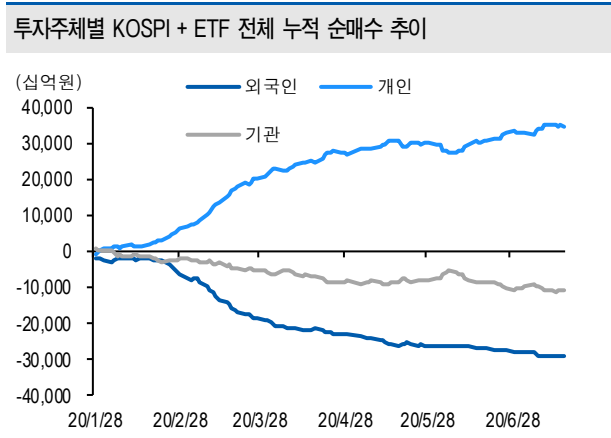


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.35	0.05	0.28	-0.10%	
베이스스(mini)	0.17	0.02	0.21	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.69	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.17	0.28	0.28	0.04%	

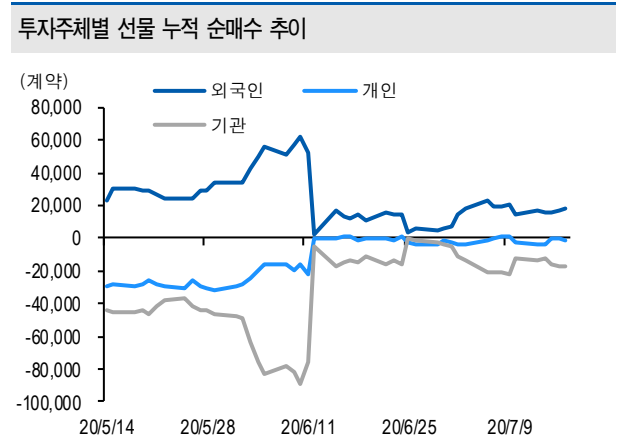


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	112.1	14.8	126.9	15.3	-20.2	79.2	26.2	0.3	0.2	-15.8	
개인	-111.3	-26.0	-137.3	0.0	0.0	-78.5	-15.5	-0.7	1.6	48.7	
기관	36.5	15.2	51.7	-11.7	7.7	-2.4	-10.7	0.8	-1.9	-35.4	
금융투자	23.8	63.5	87.3	0.0	-2.3	-315.6	-10.6	0.8	-0.6	-14.8	
투신	2.5	-35.5	-33.0	0.0	6.1	261.9	0.0	0.0	0.0	-8.8	
은행+보험+기타금융	25.3	-16.2	9.2	0.0	4.8	42.1	0.0	0.0	-1.3	1.5	
연기금+국가지자체	9.4	1.6	11.0	-11.7	-2.9	9.2	0.0	0.0	0.0	-13.3	
기타법인	-37.3	-4.0	-41.2	0.0	-1.3	1.7	0.0	-0.4	0.1	2.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





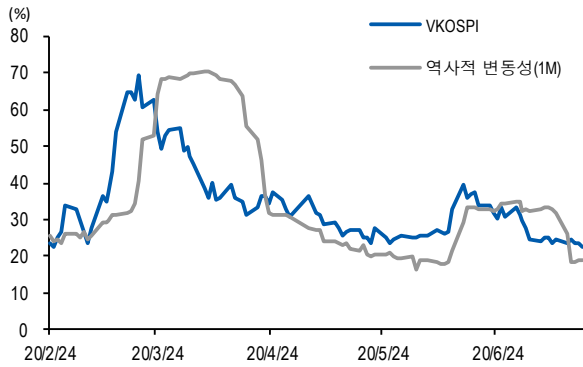
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	450,949	166.0	628,321	18.5%	지수옵션 전체	815,101	292.0	1,616,768
Put	364,152	126.0	988,447	20.9%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	22.34%(-1.14%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	3.57	0.61	23,075	8,143	699	18.5	Put	292.5(K+1)	6.49	-1.73	1,026	3,411	138	18.9
	295.0(K+2)	4.62	0.78	14,929	8,786	-958	18.9		290.0(K+0)	5.40	-1.54	4,786	4,387	249	19.4
	292.5(K+1)	5.81	0.93	3,714	5,491	246	19.2		287.5(K-1)	4.52	-1.34	4,478	4,860	273	20.1
	290.0(K+0)	7.25	1.15	2,616	7,970	-66	19.7		285.0(K-2)	3.77	-1.15	20,461	7,872	686	20.7
	287.5(K-1)	8.84	1.33	1,806	6,684	131	20.3		282.5(K-3)	3.09	-1.04	14,213	5,972	1,668	21.2

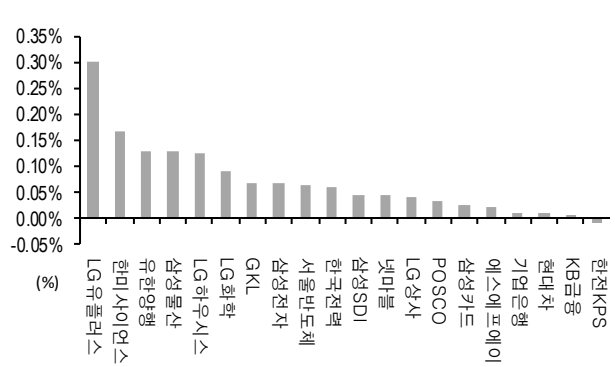
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,272,225	2,016.6	4,388,016	78,561	-47,177	62,480	-16,144	-15.8	48.7	-35.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KODEX												
삼성그룹	7,200	-1.03	0.6	110.9	89	-54	-0.14%	0	0	0	0	0
삼성 SDI	385,000	-0.39	117.8	86.7	20,047	1,277	0.05%	698	669	-1,357	114	-1,311
대림산업	88,600	-0.78	8.2	79.8	17,930	-484	-0.08%	-537	-266	789	143	639
NAVER	276,500	1.47	169.3	66.5	32,984	-829	-0.05%	-945	-159	1,031	423	504
카카오	323,500	0.47	263.5	64.4	37,194	-266	-0.16%	-152	188	-185	-1,073	-403
호텔신라	71,200	-0.97	14.7	63.3	19,221	916	-0.15%	-1,569	1,309	260	-124	520
LG 전자	75,900	1.88	57.8	62.7	33,223	870	-0.14%	-1,005	-741	1,650	1,719	317
이마트	113,000	-1.31	7.1	61.1	12,374	-2,964	-0.29%	-106	568	-478	2,859	301
LG 이노텍	162,500	0.00	12.2	58.9	9,659	186	-0.84%	-106	260	-195	-436	-40
삼성전자	54,500	1.11	322.0	58.8	1,179,092	35,076	0.07%	-13,650	21,413	-7,802	-14,951	-225

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

