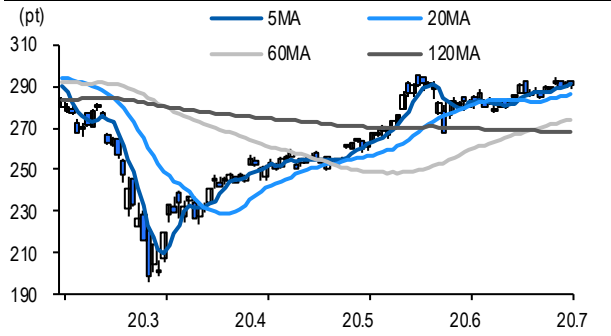


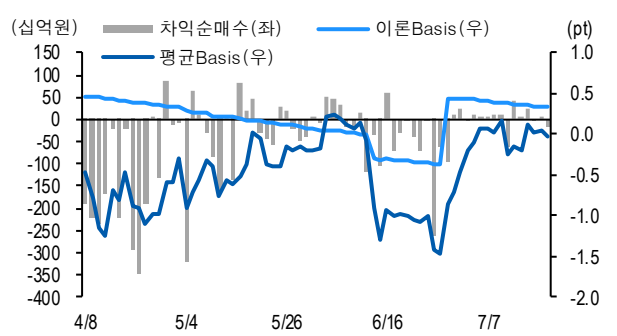


선물옵션시장 지표 2020.7.21

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	290.81	-0.26	-0.76	7,846.1	-
선물 9월물	290.90	-0.33	-0.95	13,896.1	292,406
선물 12월물	290.20	-0.33	-0.95	12.5	37,575
8월물(mini)	291.00	-0.27	-0.78	1,408.0	46,814
9월물(mini)	290.86	-0.34	-1.04	16.4	18,592

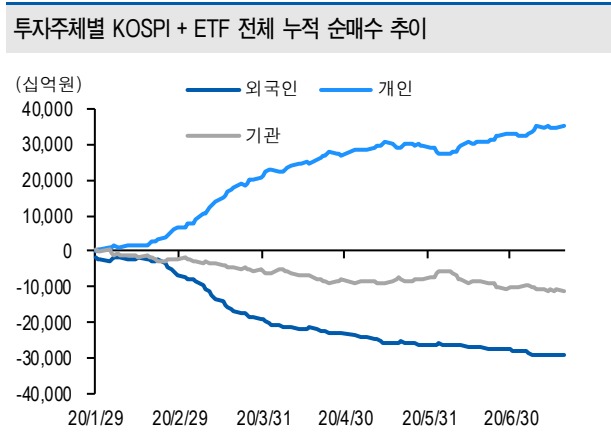


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.33	-0.04	0.09	-0.13%	
베이스스(mini)	0.15	-0.03	0.19	-0.06%	
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.69	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	0.14	0.14	0.00%	

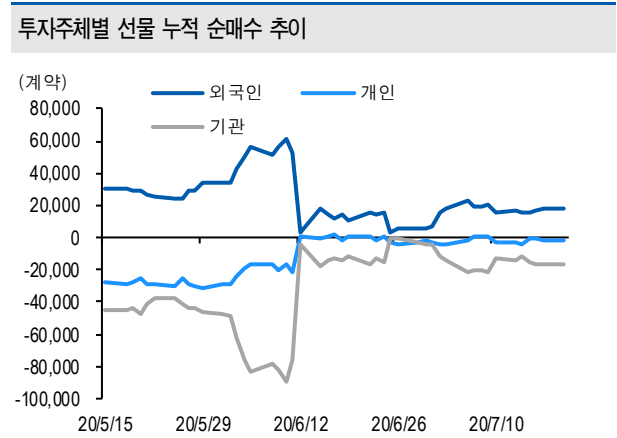


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	112.1	14.8	126.9	15.3	-20.2	79.2	26.2	0.3	0.2	-15.8	
개인	-111.3	-26.0	-137.3	0.0	0.0	-78.5	-15.5	-0.7	1.6	48.7	
기관	36.5	15.2	51.7	-11.7	7.7	-2.4	-10.7	0.8	-1.9	-35.4	
금융투자	23.8	63.5	87.3	0.0	-2.3	-315.6	-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+국가자차체	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

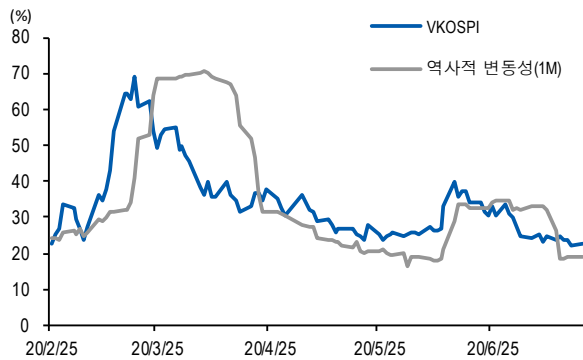
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	545,060	165.3	641,166	17.9%	지수옵션 전체	999,167	326.6	1,660,072
Put	454,107	161.3	1,018,906	20.3%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	22.37%(+0.03%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	2.12	-0.58	62,396	18,974	2,742	17.8	Put	295.0(K+1)	7.89	0.12	636	1,880	222	18.5
	297.5(K+2)	2.87	-0.70	32,055	9,109	966	18.0		292.5(K+0)	6.51	0.02	2,168	3,571	160	18.8
	295.0(K+1)	3.82	-0.80	15,827	7,743	-1,043	18.3		290.0(K-1)	5.38	-0.02	5,972	4,480	93	19.3
	292.5(K+0)	4.96	-0.85	7,507	5,725	234	18.7		287.5(K-2)	4.41	-0.11	9,649	5,650	790	19.8
	290.0(K-1)	6.30	-0.95	4,046	8,410	440	19.1		285.0(K-3)	3.62	-0.15	16,079	8,175	303	20.5

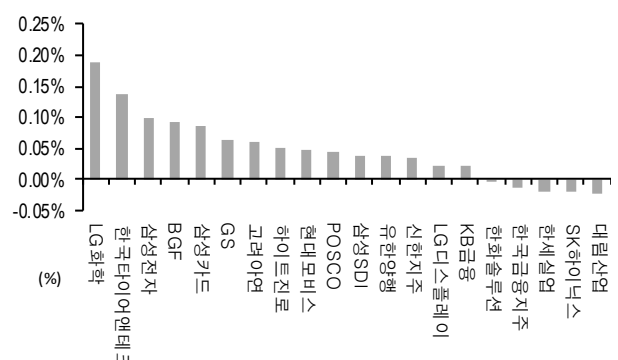
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,941,258	2,220.2	4,518,336	130,320	76,519	-38,315	-42,098	11.4	-19.6	9.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	379,000	-1.56	83.1	85.2	19,797	-250	0.04%	-411	310	102	1	262
LG 이노텍	160,000	-1.54	27.2	71.6	11,241	1,582	-1.02%	2,044	-423	-1,619	-1,670	290
LG 전자	75,900	0.00	43.2	63.8	31,166	-2,057	-0.16%	-1,734	2,285	-793	-2,201	3,055
LG	71,800	-0.69	6.0	61.4	5,775	418	-0.08%	240	310	-550	395	-945
호텔신라	70,700	-0.70	12.6	60.9	17,738	-1,483	-0.09%	1,658	-2,503	842	1,494	-480
삼성전자	54,300	-0.37	343.7	60.6	1,186,802	7,710	0.10%	27,932	-35,085	7,539	14,157	-9,687
GS 건설	27,550	0.92	6.6	60.4	49,121	1,696	-0.05%	1,977	538	-2,514	-18	-2,919
현대건설	35,850	2.43	17.6	57.0	28,834	12,806	-0.12%	3,864	299	-4,155	-6,032	-8,367
대림산업	91,700	3.50	13.4	56.3	19,385	1,455	-0.02%	811	585	-1,421	-699	-880
삼성전기	131,000	0.00	29.3	55.8	18,489	-2,452	-0.16%	-164	-2,535	2,898	1,110	432

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터