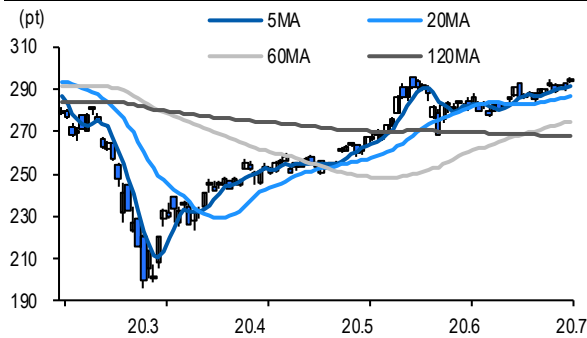


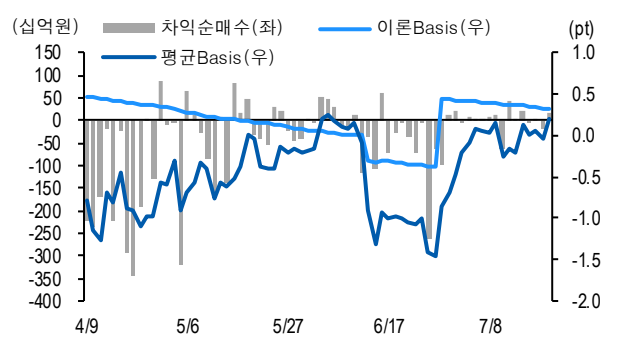


선물옵션시장 지표 2020.7.22

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	295.16	1.50	4.35	11,478.9	-
선물 9월물	295.05	1.43	4.15	15,249.9	296,943
선물 12월물	294.50	1.48	4.30	91.4	37,290
8월물(mini)	294.98	1.37	3.98	1,595.2	53,459
9월물(mini)	295.06	1.43	4.20	12.3	18,549

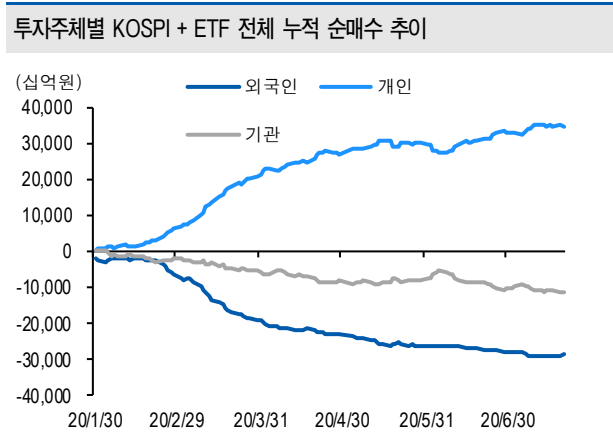


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.33	0.19	-0.11	-0.05%	
베이스(mini)	0.15	0.14	-0.18	0.00%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.67	-0.65	-0.21%	
합성선물 베이스(ATM)	0.15	-0.21	-0.21	-0.12%	

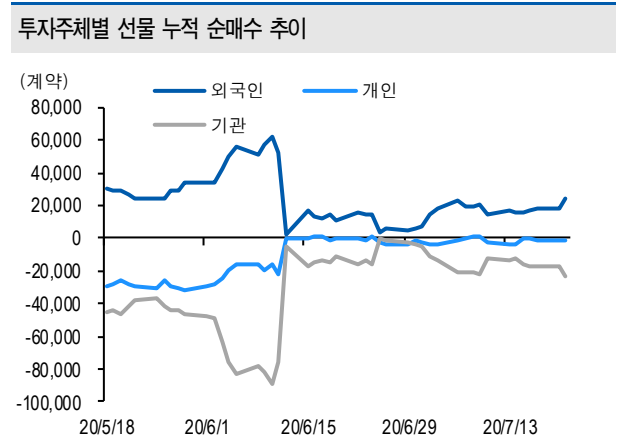


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	444.8	47.7	492.5	0.0	193.6	249.5	265.4	-0.5	-1.4	7.0
개인	-567.7	-42.4	-610.1	0.0	-0.9	68.5	-14.0	1.0	-0.9	40.8
기관	143.5	-7.1	136.5	19.1	-206.2	-282.2	-251.2	-0.8	2.9	-51.7
금융투자	320.1	88.4	408.5	0.0	1.2	-597.7	-251.3	-0.7	2.6	-8.7
투신	-49.4	-12.5	-62.0	1.5	-48.2	256.4	0.1	0.1	0.0	0.4
은행+보험+기타금융	-34.4	-72.0	-106.4	0.0	-30.5	85.6	0.0	-0.1	0.3	0.7
연기금+국가자재	-41.6	-6.3	-47.9	17.6	-94.8	-26.5	0.0	0.0	0.0	-44.1
기타법인	-20.7	1.8	-18.8	0.0	-0.4	-35.8	-0.2	0.3	-0.6	3.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





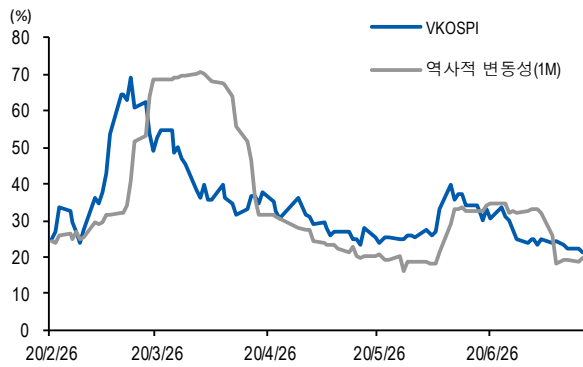
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	586,605	230.1	657,473	17.2%	지수옵션 전체	1,043,834	377.0	1,713,012		
Put	457,229	146.9	1,055,539	20.6%	PCR(금액기준)	0.64	VKOSPI	21.09%(-1.28%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	4.20	1.33	20,749	10,152	1,043	17.2	Put	292.5(K+1)	4.44	-2.07	5,888	3,931	360	19.1
	295.0(K+2)	5.45	1.63	9,862	8,399	656	17.5		290.0(K+0)	3.58	-1.80	13,682	5,059	579	19.6
	292.5(K+1)	6.90	1.94	2,918	5,411	-314	17.9		287.5(K-1)	2.87	-1.54	18,664	6,603	953	20.1
	290.0(K+0)	8.53	2.23	3,638	7,710	-700	18.3		285.0(K-2)	2.30	-1.32	28,411	11,516	3,341	20.6
	287.5(K-1)	10.35	2.50	651	6,876	-21	18.8		282.5(K-3)	1.83	-1.16	21,072	6,669	581	21.2

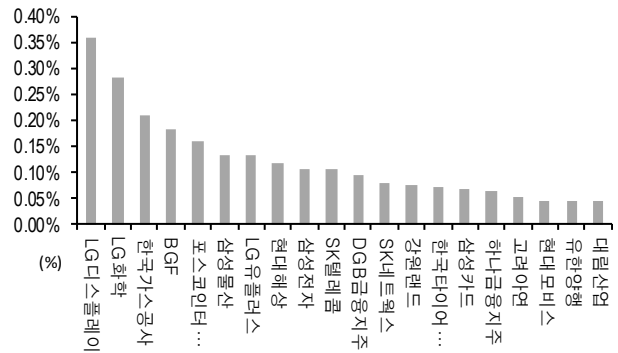
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,099,428	2,473.8	4,831,734	313,398	-53,343	-7,259	56,323	7.0	40.8	-51.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	388,500	2.51	99.1	65.1	19,594	-203	0.03%	-305	399	0	-56	254
GS 건설	27,550	0.00	5.8	60.6	45,598	-3,523	-0.08%	970	168	-1,154	-1,943	2,779
카카오	315,500	1.61	312.0	58.3	35,028	-313	-0.19%	407	1,317	-1,860	-49	-459
NAVER	270,500	2.66	178.6	55.9	32,873	1,089	-0.07%	-526	2,637	-2,053	-949	-307
KB 금융	37,100	0.27	40.4	53.3	119,595	-9,078	-0.04%	-4,968	-4,421	8,972	-18	11,530
LG 화학	531,000	3.51	124.9	48.2	41,308	1,792	0.28%	-512	29	488	-24	-737
대림산업	90,300	-1.53	9.0	48.0	19,432	47	0.04%	-318	651	-366	-405	7
SK 하이닉스	84,600	2.67	157.1	44.7	118,952	15,405	0.02%	-1,220	13,780	-12,538	-7,938	-5,748
삼성전기	137,000	4.58	63.7	43.0	24,717	6,228	-0.02%	2,999	2,133	-5,147	-4,020	-3,079
호텔신라	72,200	2.12	13.1	42.8	16,988	-750	-0.11%	-725	-25	745	504	90

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터