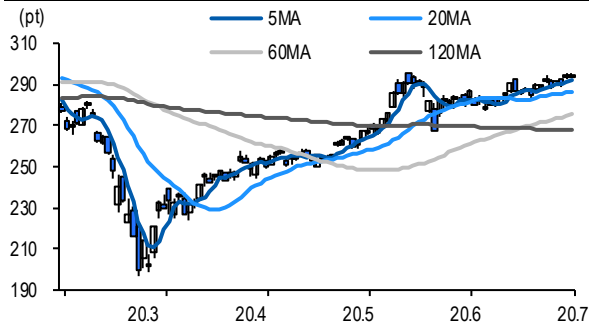


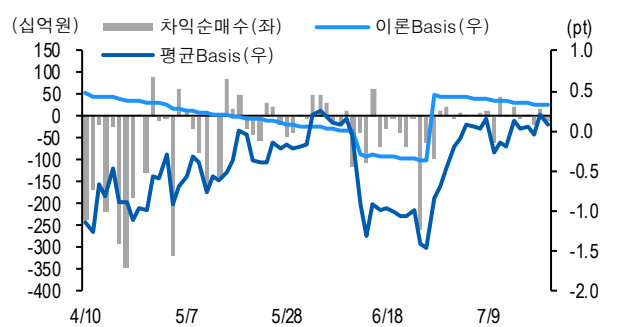


선물옵션시장 지표 2020.7.23

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	294.04	-0.38	-1.12	9,978.7	-	
선물 9월물	294.30	-0.25	-0.75	14,661.3	295,789	
선물 12월물	293.65	-0.29	-0.85	12.9	37,310	
8월물(mini)	294.22	-0.26	-0.76	1,373.9	50,509	
9월물(mini)	294.32	-0.25	-0.74	11.2	18,730	

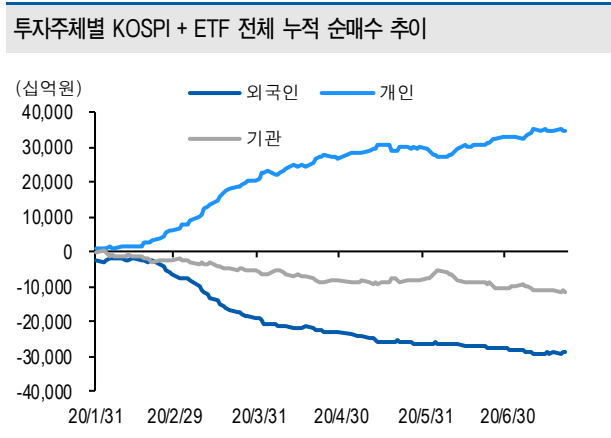


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.32	0.08	0.26	-0.08%	
베이스스(mini)	0.14	0.03	0.18	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.60	-0.60	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.14	0.20	0.20	0.02%	

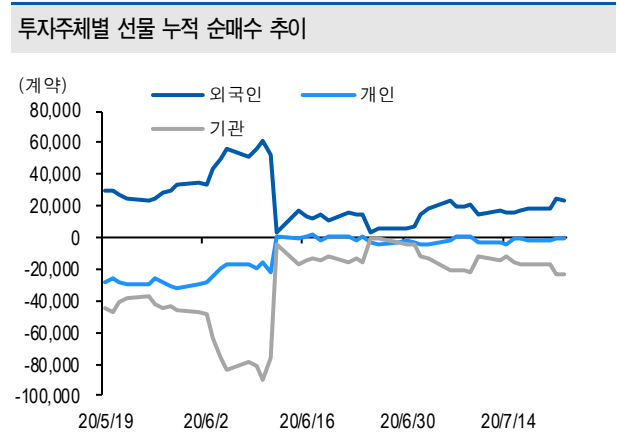


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-102.4	-0.2	-102.6	0.0	-104.7	16.1	-92.2	-0.7	-0.1	1.1	
개인	361.7	-52.1	309.6	0.0	1.7	5.7	14.6	0.4	-0.2	12.4	
기관	-241.9	52.2	-189.7	-8.8	-115.0	-50.3	78.0	1.0	0.7	-15.3	
금융투자	-73.6	107.7	34.0	0.0	-12.2	171.3	78.6	1.3	0.9	-38.0	
투신	-54.5	6.1	-48.4	0.0	-33.3	-288.3	-0.6	0.0	-0.1	12.2	
은행+보험+기타금융	-23.2	-44.1	-67.3	0.0	-27.4	56.5	0.0	-0.3	0.0	-0.6	
연기금+국가자자체	-37.8	-6.7	-44.6	-8.8	-25.9	10.2	0.0	0.0	0.0	11.1	
기타법인	-17.4	0.1	-17.3	0.0	0.0	28.5	-0.4	-0.7	-0.4	1.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	528,573	169.6	671,063	17.0%	지수옵션 전체	960,365	308.6	1,747,010		
Put	431,792	139.0	1,075,947	18.7%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	20.82%(-0.27%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	302.5(K+3)	1.97	-0.42	51,620	11,958	646	17.0	Put	297.5(K+1)	6.90	0.15	1,007	892	120	17.1
	300.0(K+2)	2.68	-0.51	34,393	23,439	283	17.0		295.0(K+0)	5.54	0.07	8,125	5,255	1,413	17.4
	297.5(K+1)	3.62	-0.58	18,007	10,612	460	17.2		292.5(K-1)	4.45	0.01	8,658	3,955	24	17.9
	295.0(K+0)	4.78	-0.67	7,932	10,575	2,176	17.6		290.0(K-2)	3.54	-0.04	20,562	5,864	805	18.4
	292.5(K-1)	6.16	-0.74	3,004	5,233	-178	18.0		287.5(K-3)	2.77	-0.10	25,247	7,683	1,080	18.8

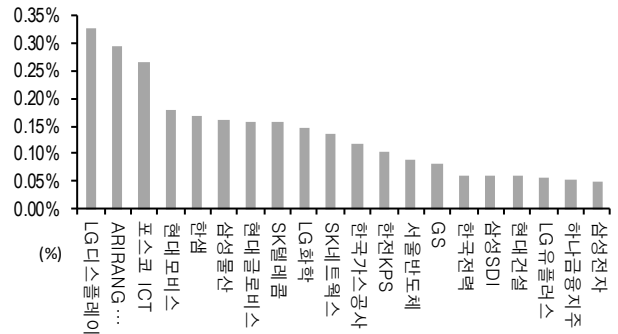
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,054,875	2,579.3	4,928,570	96,836	-36,592	1,837	33,069	1.1	12.4	-15.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	389,000	0.13	81.8	83.7	20,902	1,308	0.06%	610	85	-795	-469	-827
카카오	318,500	0.95	290.1	79.9	36,358	1,330	-0.13%	-114	-173	147	1,827	-2,349
NAVER	271,000	0.18	187.1	77.3	34,674	1,801	0.02%	2,004	452	-2,488	-2,889	-376
대림산업	89,500	-0.89	12.5	68.4	18,347	-1,085	-0.01%	-860	-209	1,071	-124	1,659
LG 이노텍	160,000	-5.88	34.6	65.0	15,476	3,441	-1.80%	1,279	-1,023	-260	-151	856
기아차	35,600	-3.26	50.5	64.4	30,333	-5,323	-0.16%	-107	2,545	-2,288	-582	1,074
삼성전자	54,900	-1.08	442.3	63.7	1,261,951	-31,863	0.05%	16,342	-329	-16,776	-44,338	31,969
삼성전기	141,000	2.92	142.0	58.7	38,714	13,997	-0.23%	-5,496	3,494	2,029	624	-3,096
현대건설	35,700	0.99	19.0	51.0	33,964	3,901	0.06%	1,251	1,236	-2,510	-2,866	-4,663
금호석유	88,700	-0.45	9.2	50.5	3,016	758	-0.19%	498	431	-929	-671	-250

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터