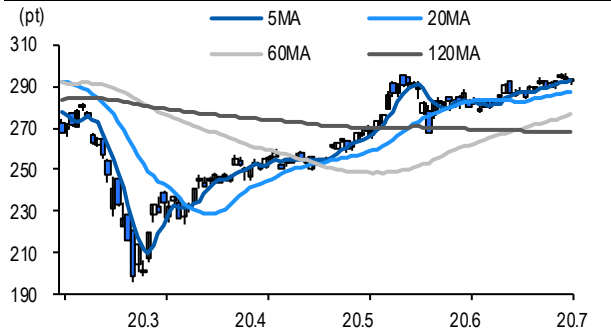


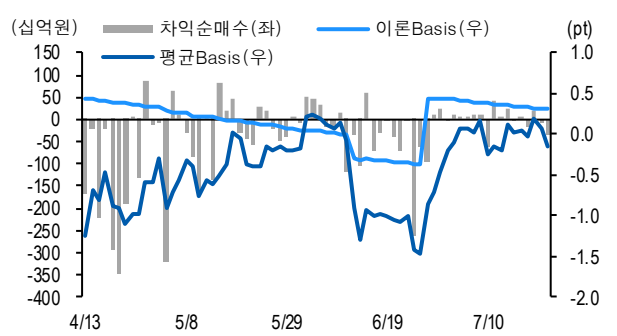


선물옵션시장 지표 2020.7.24

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	292.37	-0.57	-1.67	10,993.5	-
선물 9월물	292.00	-0.78	-2.30	18,016.5	295,273
선물 12월물	291.40	-0.77	-2.25	19.4	37,386
8월물(mini)	292.10	-0.72	-2.12	1,740.2	47,995
9월물(mini)	291.90	-0.82	-2.42	11.8	18,823

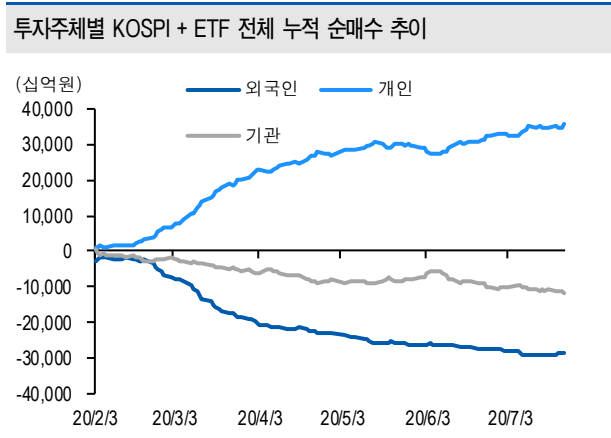


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.31	-0.15	-0.37	-0.16%	
베이스(mini)	0.13	-0.05	-0.27	-0.06%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.60	-0.60	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.13	-0.29	-0.29	-0.14%	

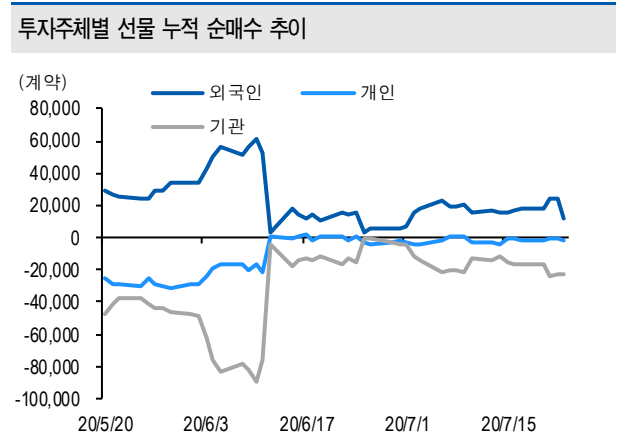


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-209.2	37.9	-171.2	0.0	-138.7	-507.8	-338.9	0.4	-1.9	-17.4
개인	777.8	-78.1	699.6	0.0	-0.8	-110.1	5.8	-0.9	-1.6	28.8
기관	-590.9	34.4	-556.5	-35.3	-44.6	627.3	332.7	0.3	3.5	-10.0
금융투자	-354.7	49.5	-305.2	0.0	-4.0	861.3	332.6	0.2	3.3	7.1
투신	-112.0	-36.6	-148.6	0.0	-27.8	-277.2	0.1	0.1	0.2	-7.9
은행+보험+기타금융	-4.6	19.7	15.1	0.0	-6.7	11.1	0.0	0.0	0.0	0.7
연기금+국가자재	-58.1	1.7	-56.4	-35.3	0.6	32.1	-0.1	0.0	0.0	-9.9
기타법인	22.3	5.8	28.1	0.0	0.1	-9.4	0.5	0.1	0.0	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





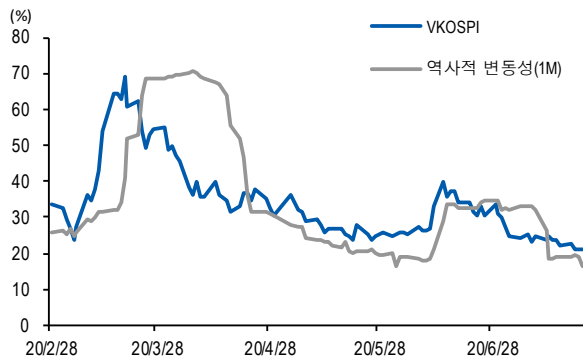
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	513,850	162.6	695,871	16.5%	지수옵션 전체	1,128,500	388.7	1,786,128
Put	614,650	226.1	1,090,257	19.1%	PCR(금액기준)	1.39	VKOSPI	21.00%(+0.18%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	302.5(K+3)	1.36	-0.61	48,401	12,711	753	16.4	Put	297.5(K+1)	8.07	1.17	1,568	1,270	378	18.0
	300.0(K+2)	1.94	-0.74	63,585	22,217	-1,222	16.5		295.0(K+0)	6.56	1.02	8,188	5,091	-164	18.2
	297.5(K+1)	2.68	-0.94	33,920	10,457	-155	16.5		292.5(K-1)	5.26	0.81	7,196	3,961	6	18.4
	295.0(K+0)	3.64	-1.14	26,887	10,341	-234	16.6		290.0(K-2)	4.18	0.64	20,375	6,192	328	18.7
	292.5(K-1)	4.84	-1.32	10,166	5,073	-160	16.9		287.5(K-3)	3.31	0.54	25,817	8,360	677	19.2

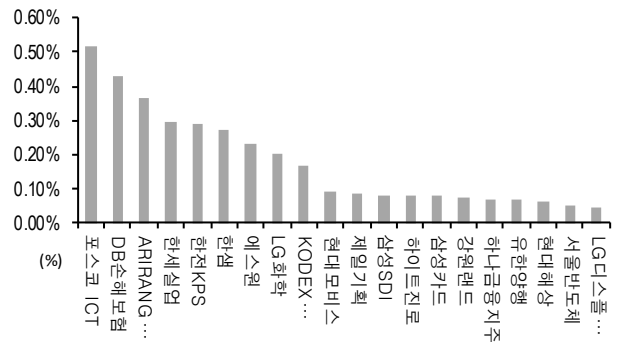
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,622,659	2,716.2	4,958,816	30,246	4,027	19,618	-26,154	-17.4	28.8	-10.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아차	36,800	3.37	86.7	83.2	36,750	6,417	-0.10%	4,120	5,289	-9,531	-2,630	-7,728
삼성 SDI	388,000	-0.26	73.9	80.3	20,843	-59	0.08%	-489	350	140	225	-46
대림산업	87,200	-2.57	8.8	69.0	16,660	-1,687	-0.09%	43	363	-426	-343	717
NAVER	284,000	4.80	256.1	65.4	43,527	8,853	0.03%	921	3,473	-4,362	-1,292	-5,497
카카오	329,000	3.30	261.0	63.8	36,607	249	-0.18%	-32	-535	775	-317	135
현대모비스	211,500	0.24	67.4	62.8	26,249	3,572	0.09%	1,647	-1	-1,646	-1,318	-2,431
현대차	125,000	5.93	331.8	60.9	98,175	9,869	-0.05%	-2,779	5,900	-1,979	3,606	-6,375
KODEX 삼성그룹	7,275	-0.21	0.5	59.0	97	-95	0.17%	0	1	-1	-1	0
현대건설	34,850	-2.38	14.4	53.9	29,696	-4,268	-0.01%	-4,275	-1,191	5,458	1,401	1,980
LG 화학	535,000	1.13	77.0	53.9	39,782	767	0.20%	-912	340	581	481	-114

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

