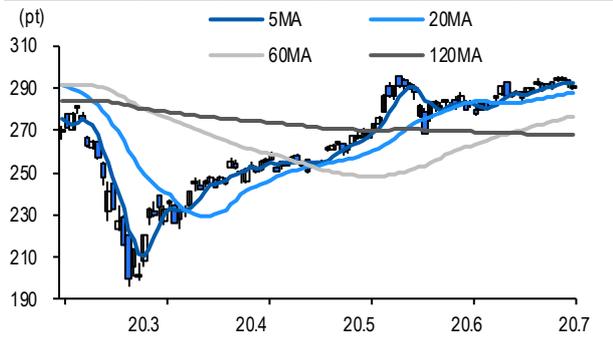


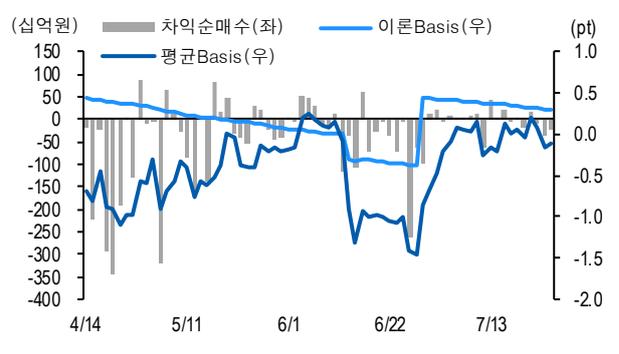


선물옵션시장 지표 2020.7.27

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	290.66	-0.58	-1.71	9,750.2	-
선물 9월물	290.30	-0.58	-1.70	16,127.1	297,316
선물 12월물	289.80	-0.55	-1.60	11.3	37,397
8월물(mini)	290.42	-0.58	-1.68	1,353.7	48,233
9월물(mini)	290.62	-0.47	-1.28	23.9	19,156

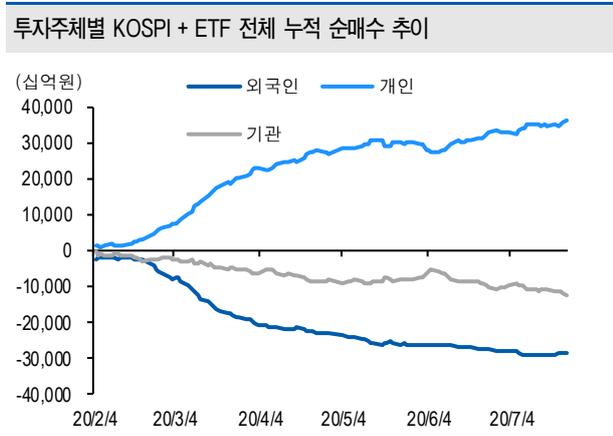


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.30	-0.12	-0.36	-0.14%	
베이스스(mini)	0.12	-0.02	-0.24	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.62	-0.65	-0.19%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	-0.17	-0.17	-0.10%	

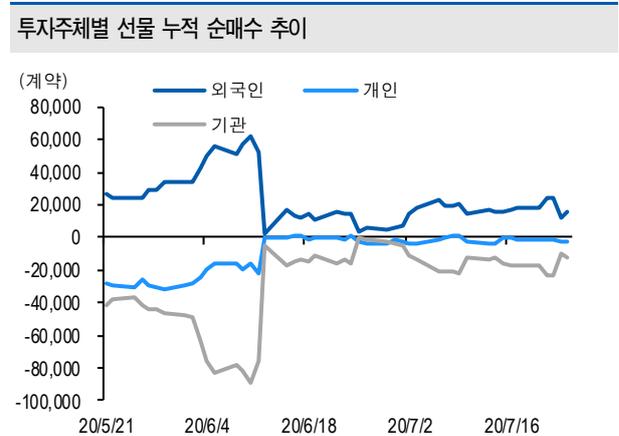


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	87.4	-11.8	75.6	0.0	-53.7	271.3	-27.1	-4.6	-1.0	-54.8	
개인	285.9	114.6	400.5	0.0	2.0	-46.9	-17.4	2.2	2.5	-25.6	
기관	-365.1	-105.6	-470.7	-24.6	-63.0	-224.5	44.2	2.3	-1.4	80.4	
금융투자	-116.1	-120.5	-236.6	0.0	-0.1	-453.4	45.2	2.3	-1.5	22.2	
투신	-41.5	-2.3	-43.8	0.0	-22.5	206.9	-1.0	0.0	0.0	-3.5	
은행+보험+기타금융	-59.6	13.9	-45.6	0.0	-43.0	-3.1	0.0	0.0	0.0	1.1	
연기금+국가자차체	-106.6	0.4	-106.3	-24.6	5.4	25.1	0.0	0.0	0.0	60.6	
기타법인	-8.2	2.9	-5.4	0.0	0.6	0.0	0.3	0.1	-0.1	0.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	617,952	186.2	713,199	17.1%	지수옵션 전체	1,318,910	395.3	1,872,070
Put	700,958	209.1	1,158,871	20.4%	PCR(금액기준)	1.12	VKOSPI	22.50%(+1.50%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	1.55	-0.39	93,881	23,088	871	17.0	Put	295.0(K+1)	7.58	1.02	2,432	5,322	231	18.6
	297.5(K+2)	2.21	-0.47	57,282	12,562	2,105	17.2		292.5(K+0)	6.16	0.90	3,798	4,067	106	18.9
	295.0(K+1)	3.07	-0.57	34,058	13,361	3,020	17.4		290.0(K-1)	4.99	0.81	14,713	6,652	460	19.4
	292.5(K+0)	4.15	-0.69	13,534	5,703	630	17.8		287.5(K-2)	4.00	0.69	26,999	9,366	1,006	19.8
	290.0(K-1)	5.49	-0.77	4,989	7,969	274	18.3		285.0(K-3)	3.23	0.62	31,717	12,502	594	20.6

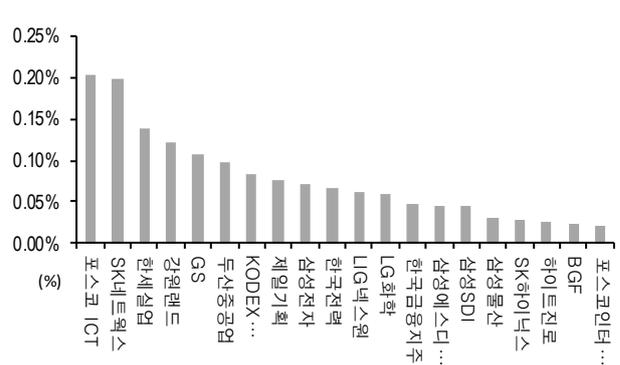
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,382,550	2,447.0	5,010,513	51,697	-55,040	-51,110	111,675	-54.8	-25.6	80.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	324,000	-1.52	263.8	89.6	36,417	-190	-0.15%	-2,307	209	2,151	1,223	798
기아차	36,850	0.14	78.1	77.4	55,669	18,919	-0.13%	-23,465	-1,931	25,428	-2,068	1,649
현대모비스	203,500	-3.78	87.0	74.1	19,369	-6,880	-0.08%	-973	90	859	858	4,211
삼성전자	54,100	0.00	411.4	69.5	1,296,507	219	0.07%	-20,516	-3,273	24,110	-8,901	21,202
현대건설	35,350	1.43	35.4	67.5	31,140	1,444	-0.01%	1,826	186	-2,003	132	-4,196
LG 전자	73,900	-0.27	33.6	65.1	21,922	325	-0.20%	874	1,688	-2,563	-510	-920
GS 건설	26,750	-1.29	5.3	61.6	45,500	1,204	-0.19%	270	385	-654	582	-2,143
현대차	123,000	-1.60	286.9	58.8	93,827	-4,348	-0.11%	-3,844	-3,745	7,592	-1,504	8,836
NAVER	280,500	-1.23	203.3	58.3	43,514	-13	0.01%	-3,493	661	2,582	-471	2,442
대림산업	86,200	-1.15	5.4	52.0	16,658	-2	0.00%	1,003	45	-1,048	26	-925

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터