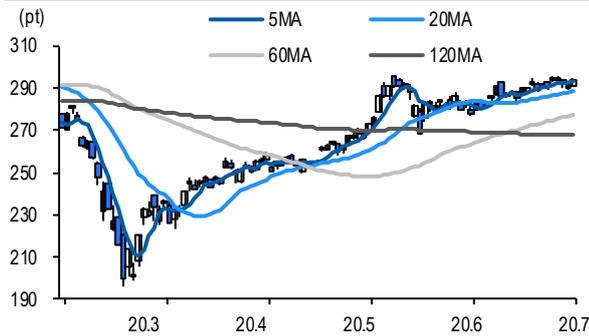


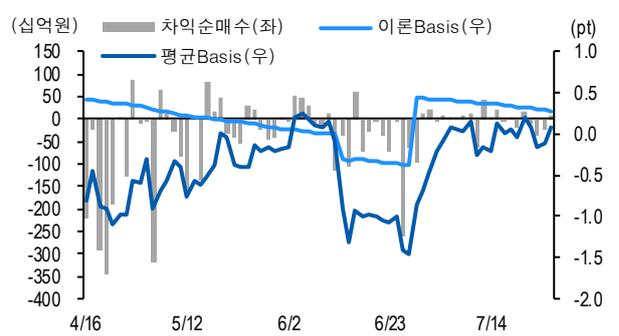


선물옵션시장 지표 2020.7.28

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	293.51	0.98	2.85	7,907.0	-
선물 9월물	294.05	1.29	3.75	16,124.2	299,396
선물 12월물	293.40	1.24	3.60	14.9	37,389
8월물(mini)	294.12	1.27	3.70	1,308.4	45,688
9월물(mini)	294.00	1.27	3.38	13.9	19,076

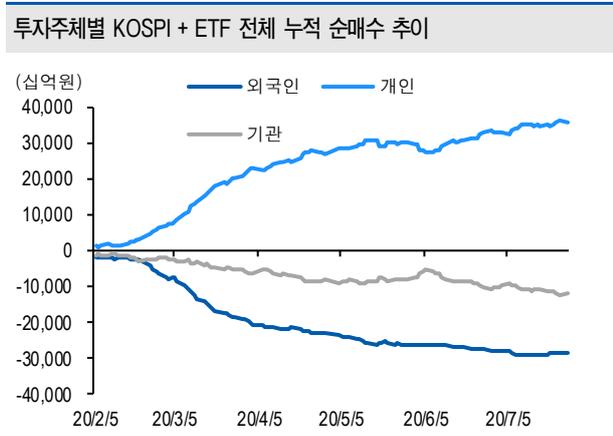


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.28	0.07	0.54	-0.07%	
베이스(mini)	0.11	0.06	0.61	-0.02%	
제1스프레드(SP)	-0.08	-0.61	-0.60	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.11	0.56	0.56	0.15%	

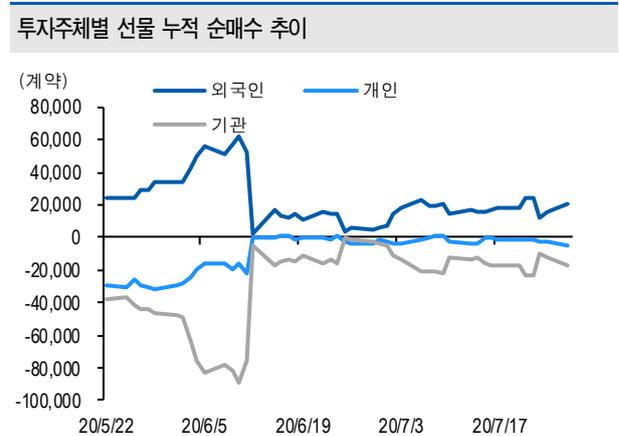


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	155.6	27.3	182.9	0.0	-49.0	207.5	193.0	1.8	0.9	18.1
개인	-298.8	-51.7	-350.5	0.0	2.1	-105.4	-11.9	-2.2	0.7	13.9
기관	141.6	32.6	174.2	5.9	-32.6	-106.8	-180.7	0.6	-1.8	-33.3
금융투자	198.5	67.5	266.0	0.0	-4.4	-359.5	-180.2	-2.4	1.0	-24.6
투신	13.1	-37.8	-24.6	0.0	29.3	273.0	-0.5	0.2	0.0	7.7
은행+보험+기타금융	-25.5	0.1	-25.4	0.0	-14.4	-21.8	0.0	2.8	-2.8	-0.6
연기금+국가지자체	-47.6	0.9	-46.7	5.9	-41.6	1.4	0.0	0.0	0.0	-15.7
기타법인	1.6	-8.2	-6.6	0.0	-0.1	4.7	-0.4	-0.2	0.2	1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	640,552	212.6	728,530	19.4%	지수옵션 전체	1,118,956	359.9	1,913,382		
Put	478,404	147.3	1,184,852	21.4%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	22.96%(+0.46%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	3.37	1.16	44,726	11,913	-649	19.4	Put	292.5(K+1)	4.38	-1.78	7,748	3,733	-334	19.0
	295.0(K+2)	4.54	1.47	20,071	13,490	129	19.9		290.0(K+0)	3.49	-1.50	18,380	7,216	564	19.7
	292.5(K+1)	5.95	1.80	5,397	5,925	222	20.7		287.5(K-1)	2.78	-1.22	25,054	9,898	532	20.5
	290.0(K+0)	7.56	2.07	3,299	7,899	-70	21.5		285.0(K-2)	2.21	-1.02	32,862	14,024	1,522	21.4
	287.5(K-1)	9.16	2.17	1,626	7,167	-95	21.7		282.5(K-3)	1.78	-0.83	28,972	7,668	120	22.3

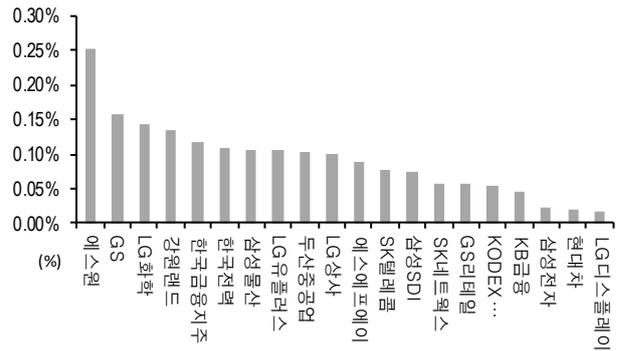
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,397,337	2,137.3	5,001,868	-8,645	-28,890	44,240	-16,310	18.1	13.9	-33.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KODEX												
삼성그룹	7,225	0.42	1.7	121.2	419	300	0.06%	0	0	0	0	0
BGF	4,200	0.72	0.4	83.2	6,074	3,283	-0.05%	-960	2,953	-1,993	-316	-1,677
기아차	37,600	2.04	58.0	71.7	55,646	-23	-0.14%	-9,707	-1,908	11,615	9,226	2,160
NAVER	285,000	1.60	136.2	69.8	44,335	821	-0.01%	114	546	-667	-2,158	2,057
삼성 SDI	378,500	0.80	84.2	67.9	22,989	3,011	0.07%	1,180	630	-1,818	-102	-2,499
현대차	123,500	0.41	165.8	65.2	97,264	3,437	0.02%	-526	-228	780	1,378	-3,700
현대건설	34,600	-2.12	22.7	65.2	18,492	-12,648	-0.16%	-491	-939	1,415	3,082	13,819
카카오	327,500	1.08	126.8	64.8	37,249	832	-0.12%	1,350	-46	-1,323	632	-2,393
삼성전자	55,600	2.77	694.4	60.2	1,288,388	-8,119	0.02%	13,187	-6,600	-9,126	-49,136	24,373
KB 금융	35,600	0.99	24.1	58.6	109,902	2,933	0.05%	1,040	-427	-640	1,383	-2,064

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

