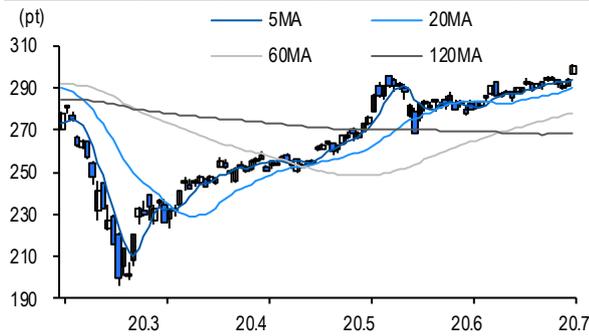


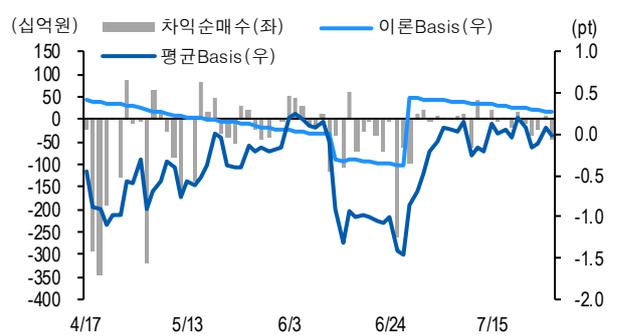


선물옵션시장 지표 2020.7.29

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	300.13	2.26	6.62	10,545.8	-
선물 9월물	299.20	1.75	5.15	21,593.3	304,617
선물 12월물	298.60	1.77	5.20	74.2	37,740
8월물(mini)	299.28	1.75	5.16	2,179.7	56,517
9월물(mini)	299.38	1.81	5.38	25.9	19,218

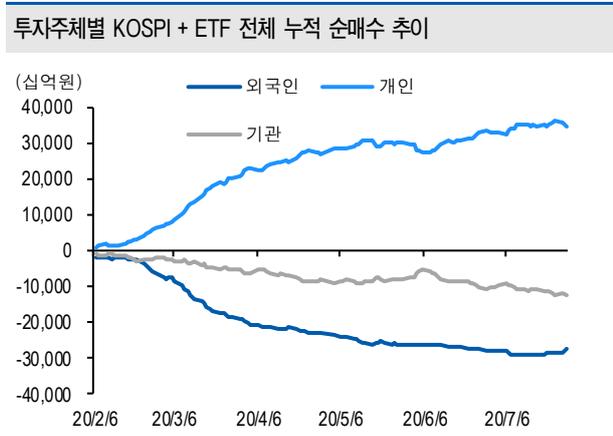


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.28	-0.01	-0.93	-0.10%	
베이스스(mini)	0.10	-0.05	-0.85	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.07	-0.58	-0.55	-0.17%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.10	-0.86	-0.86	-0.32%	

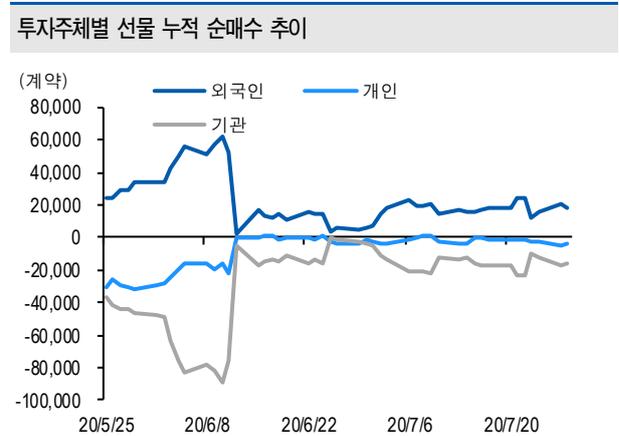


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1,305.3	7.8	1,313.1	0.5	561.8	55.6	-243.8	10.6	-2.4	-7.9
개인	-1,049.3	7.5	-1,041.7	0.0	1.8	76.7	-10.3	-5.8	0.8	108.9
기관	-221.5	-18.0	-239.4	-46.2	-87.5	-165.4	255.3	-3.9	1.7	-102.2
금융투자	-143.5	49.1	-94.4	0.0	-10.0	-343.8	255.4	-4.2	1.7	-118.3
투신	7.5	-11.8	-4.3	0.0	-24.4	140.7	-0.1	0.3	0.0	43.2
은행+보험+기타금융	-59.0	-63.3	-122.3	0.0	-33.2	1.8	0.0	0.0	0.0	0.7
연기금+국가지자체	-50.7	2.8	-47.9	-46.2	-17.4	36.0	0.0	0.0	0.0	-27.7
기타법인	-34.5	2.6	-31.9	0.0	-0.2	33.1	-1.2	-1.0	-0.2	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,099,231	392.4	732,275	17.5%	지수옵션 전체	1,819,023	604.8	1,958,691
Put	719,792	212.4	1,226,416	23.6%	PCR(금액기준)	0.54	VKOSPI	22.92%(-0.04%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	4.65	2.20	40,853	22,778	-1,187	17.5	Put	295.0(K+1)	3.38	-2.09	25,844	6,481	548	21.9
	297.5(K+2)	6.04	2.67	12,632	11,624	-289	17.7		292.5(K+0)	2.68	-1.70	35,922	5,556	1,823	22.5
	295.0(K+1)	7.65	3.11	12,951	10,085	-3,405	17.8		290.0(K-1)	2.13	-1.36	62,722	10,549	3,333	23.2
	292.5(K+0)	9.45	3.50	4,304	5,227	-698	18.0		287.5(K-2)	1.68	-1.10	47,512	11,355	1,457	23.8
	290.0(K-1)	11.50	3.94	1,385	7,561	-338	18.6		285.0(K-3)	1.38	-0.83	55,582	16,152	2,128	24.9

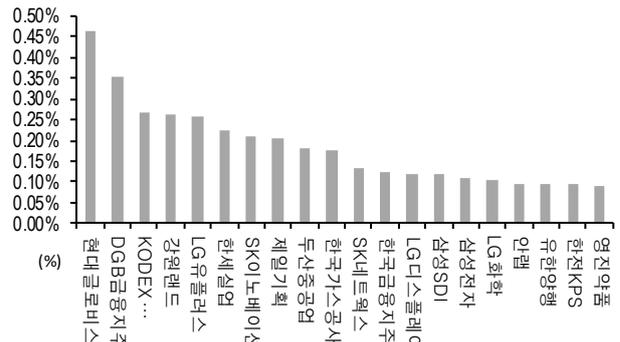
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,922,725	3,458.0	5,221,282	219,414	-4,622	167,121	-161,314	-7.9	108.9	-102.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	393,000	3.83	311.6	75.1	32,246	9,257	0.12%	-920	560	77	-4,507	-745
카카오	329,500	0.61	192.2	66.7	39,797	2,548	-0.10%	-1,481	2,037	-882	97	-1,727
삼성전자	58,700	5.58	1,623.4	58.3	1,490,529	202,141	0.11%	21,541	145,542	-163,768	-155,202	-59,917
LG 화학	530,000	1.73	110.5	56.4	36,358	-2,342	0.10%	205	859	-1,095	-1,142	1,550
NAVER	288,500	1.23	136.1	48.4	45,035	700	0.02%	-309	906	-565	-1,266	730
기아차	37,800	0.53	29.4	46.1	50,753	-4,893	-0.12%	-931	-5,893	6,824	2,157	5,010
KB 금융	35,750	0.42	27.4	44.2	107,380	-2,522	0.04%	-1,232	-232	1,431	-779	2,399
현대차	123,000	-0.40	95.1	43.8	93,917	-3,347	0.06%	-292	1,210	-908	-995	610
SK 이노베이션	133,500	1.91	31.2	42.1	36,635	3,161	0.21%	480	-26	-466	-1,653	-976
고려아연	432,500	0.93	29.2	36.9	1,958	-51	-0.01%	-201	80	121	-52	108

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

