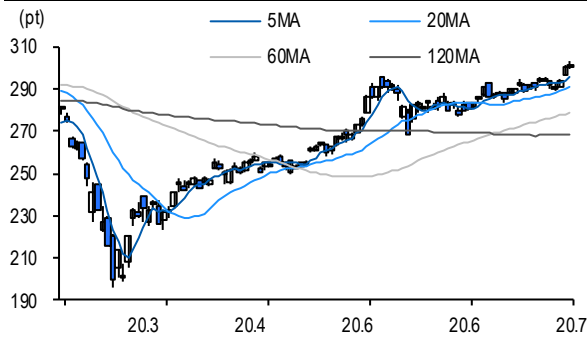


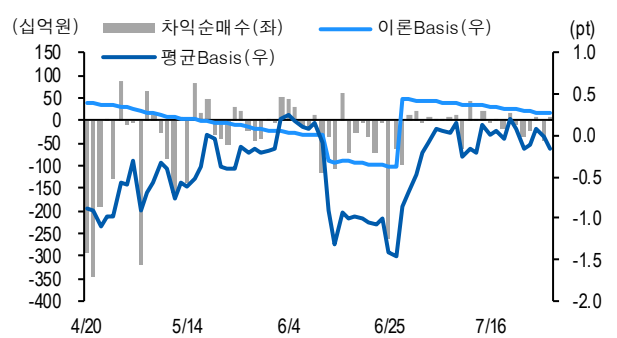


선물옵션시장 지표 2020.7.30

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	301.25	0.37	1.12	9,182.5	-	
선물 9월물	301.20	0.67	2.00	19,207.8	304,332	
선물 12월물	300.75	0.72	2.15	67.2	37,981	
8월물(mini)	301.16	0.63	1.88	1,784.6	61,155	
9월물(mini)	302.32	1.04	2.94	23.4	19,404	

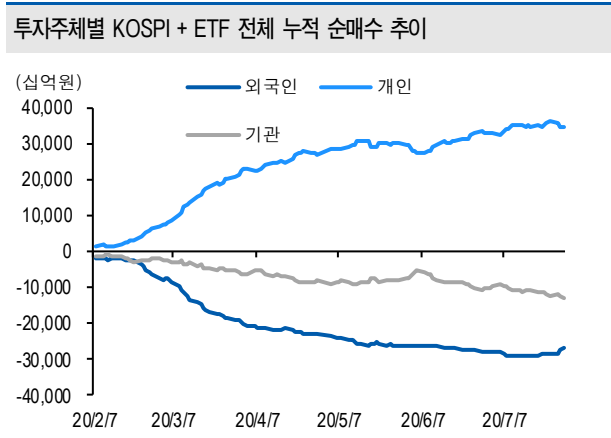


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.28	-0.15	-0.05	-0.14%	
베이스스(mini)	0.10	-0.14	-0.09	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.55	-0.55	-0.16%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.10	-0.07	-0.07	-0.06%	

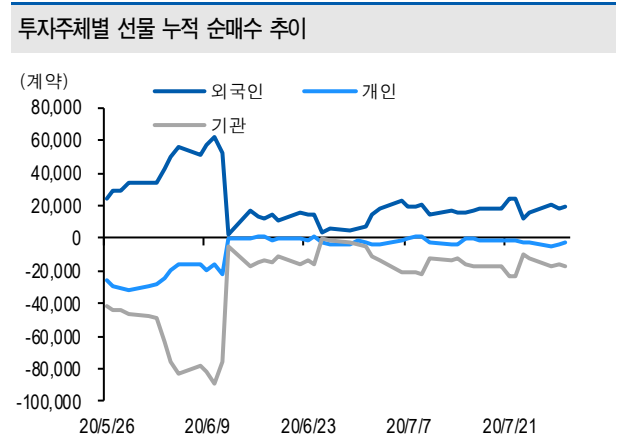


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	293.7	26.7	320.3	0.0	-67.8	154.1	-89.3	0.4	-2.0	-34.5	
개인	48.0	54.7	102.7	0.0	-1.5	76.5	-1.4	1.4	0.3	-12.3	
기관	-337.4	-81.4	-418.7	7.5	-138.6	-207.9	90.9	-1.4	1.8	47.7	
금융투자	-135.1	-46.6	-181.6	0.0	-10.9	21.0	90.7	-1.4	2.3	33.7	
투신	-37.2	-10.6	-47.8	-0.1	-42.9	-211.3	0.2	0.0	0.1	-8.7	
은행+보험+기타금융	-39.5	-38.5	-78.0	-0.2	-18.2	7.5	0.0	0.0	-0.6	-0.4	
연기금+국가지자체	-92.9	-0.2	-93.0	7.7	-34.1	-25.2	0.0	0.0	0.0	23.1	
기타법인	-4.3	0.1	-4.3	0.0	0.0	-22.7	-0.2	-0.4	-0.1	-0.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





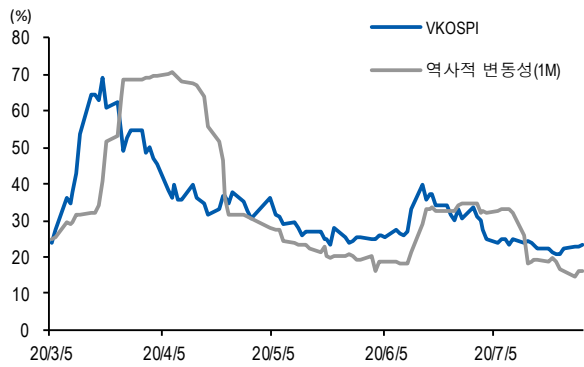
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,098,772	364.1	746,332	19.6%	지수옵션 전체	1,755,152	584.8	2,000,505
Put	656,380	220.8	1,254,173	22.3%	PCR(금액기준)	0.61	VKOSPI	23.33%(+0.41%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	307.5(K+3)	2.46	0.61	79,344	15,606	-2,184	19.4	Put	302.5(K+1)	5.73	-1.00	3,910	1,717	677	20.4
	305.0(K+2)	3.37	0.80	70,006	20,712	-2,375	19.7		300.0(K+0)	4.58	-0.80	15,268	3,829	1,083	20.8
	302.5(K+1)	4.47	0.97	36,756	15,130	906	19.9		297.5(K-1)	3.60	-0.69	24,327	4,050	882	21.2
	300.0(K+0)	5.76	1.11	14,167	22,643	-135	20.1		295.0(K-2)	2.84	-0.54	38,325	7,160	679	21.8
	297.5(K-1)	7.30	1.26	5,100	11,399	-225	20.6		292.5(K-3)	2.25	-0.43	46,049	6,216	660	22.6

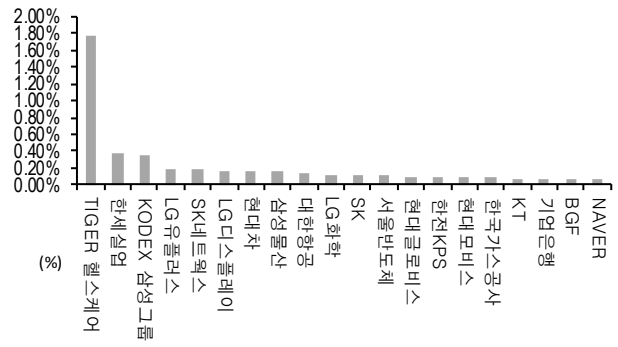
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,590,646	3,298.8	5,216,106	-5,176	-9,603	-27,082	36,631	-34.5	-12.3	47.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	332,000	0.76	184.5	90.6	38,574	-1,223	-0.08%	1,035	-1,358	613	622	-155
삼성 SDI	386,500	-1.65	191.8	76.7	21,263	-10,983	-0.14%	-1,730	-600	2,713	-738	7,983
삼성전자	59,100	0.68	1,415.6	65.8	1,454,062	-36,467	0.02%	-49,676	-1,129	50,835	5,869	52,418
현대차	125,500	2.03	136.3	58.1	98,660	4,743	0.17%	1,483	815	-2,472	946	-4,050
NAVER	293,000	1.56	159.5	58.0	52,002	6,967	0.07%	-116	1,836	-2,057	3,323	-6,715
기아차	39,750	5.16	74.7	56.6	65,484	14,731	-0.08%	5,425	7,258	-12,654	-8,399	-9,627
KB 금융	36,400	1.82	30.3	54.6	108,655	1,275	0.03%	2,506	-96	-2,445	-352	-1,822
대림산업	84,100	0.84	5.9	51.0	16,272	133	-0.02%	-258	269	83	460	-293
LG 화학	527,000	-0.57	84.2	50.5	36,441	83	0.13%	-1,110	-845	1,797	1,097	265
한국금융지주	49,950	0.10	6.7	46.2	32,447	-333	0.06%	137	-178	33	-67	100

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터