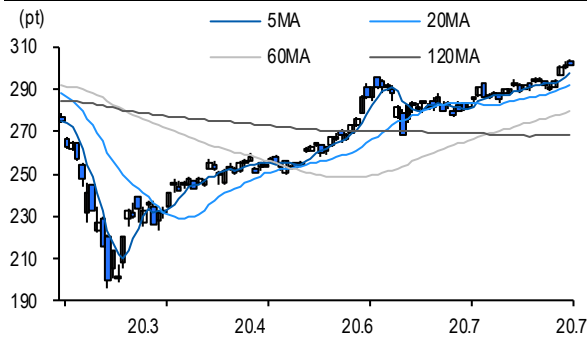
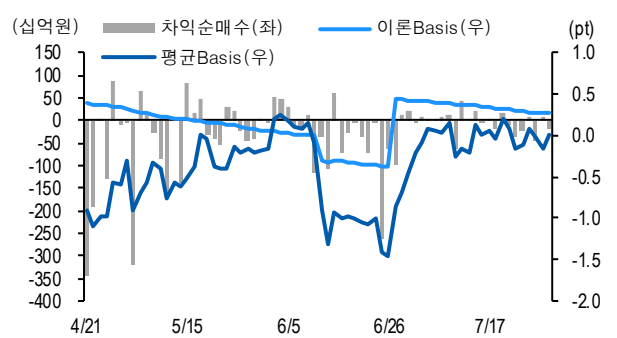


선물옵션시장 지표 2020.7.31

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	301.85	0.20	0.60	8,071.8	-
선물 9월물	301.80	0.20	0.60	15,754.2	303,582
선물 12월물	301.45	0.23	0.70	29.2	38,394
8월물(mini)	301.84	0.23	0.68	1,606.0	60,775
9월물(mini)	301.84	0.21	-0.48	16.1	19,539

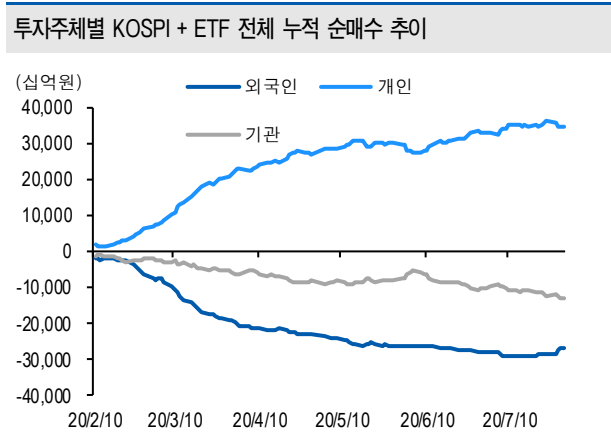


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.27	0.01	-0.05	-0.09%	
베이스(mini)	0.09	0.00	-0.01	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.50	-0.50	-0.15%	
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.06	-0.06	-0.05%	

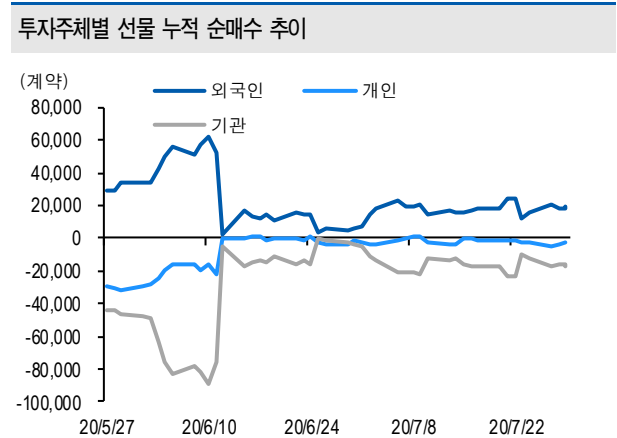


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	224.4	-6.1	218.3	0.2	54.8	-67.9	-5.7	0.4	0.4	-8.5	
개인	6.9	-22.4	-15.5	0.0	-0.3	-12.2	-0.5	-1.1	0.2	-7.5	
기관	-234.2	29.9	-204.4	-20.4	-180.6	79.2	5.4	0.5	-0.6	13.7	
금융투자	42.3	40.0	82.3	0.0	-0.8	248.3	4.3	0.0	-0.1	-16.1	
투신	-43.9	-24.6	-68.5	0.0	-28.0	-168.3	1.1	0.5	0.0	11.4	
은행+보험+기타금융	-18.7	-14.3	-32.9	0.0	-20.4	7.0	0.0	0.0	-0.5	0.0	
연기금+국가지자체	-215.1	27.0	-188.1	-20.4	-128.0	-7.8	0.0	0.0	0.0	18.4	
기타법인	2.9	-1.4	1.5	0.0	0.0	0.9	0.7	0.2	0.0	2.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

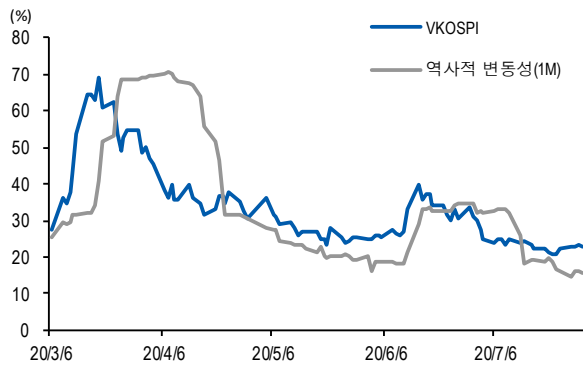
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	658,253	226.2	756,570	18.7%	지수옵션 전체	1,191,042	389.6	2,046,805
Put	532,789	163.5	1,290,235	21.2%	PCR(금액기준)	0.72	VKOSPI	22.91%(-0.42%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	1.65	-0.15	84,666	23,859	201	18.6	Put	305.0(K+1)	6.45	-0.70	2,014	1,391	205	19.4
	307.5(K+2)	2.36	-0.10	49,858	15,353	-253	18.7		302.5(K+0)	5.10	-0.63	8,032	2,867	1,150	19.7
	305.0(K+1)	3.25	-0.12	34,551	19,622	-1,090	18.8		300.0(K-1)	3.98	-0.60	20,896	4,638	809	20.1
	302.5(K+0)	4.39	-0.08	12,284	15,309	179	19.1		297.5(K-2)	3.11	-0.49	31,521	4,624	574	20.7
	300.0(K-1)	5.78	0.02	5,829	22,339	-304	19.5		295.0(K-3)	2.43	-0.41	34,877	8,676	1,516	21.5

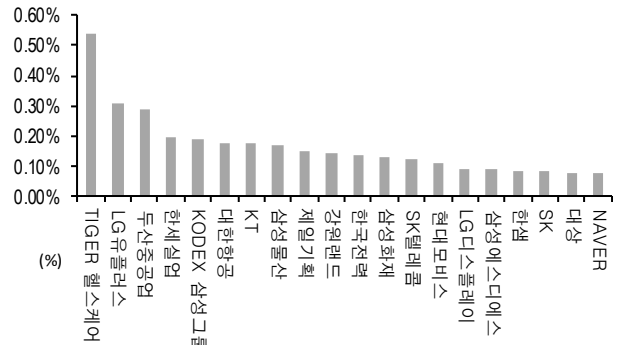
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,994,960	3,139.7	5,195,455	-20,651	-2,187	-7,661	10,173	-8.5	-7.5	13.7

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	0.00	165.0	81.2	35,523	-3,051	-0.14%	-1,349	-188	1,542	-911	3,749
삼성전자	58,900	-0.34	920.5	80.5	1,404,649	-49,413	0.02%	11,958	-23,712	13,503	-25,384	36,563
삼성 SDI	384,000	-0.65	71.3	61.3	20,110	-1,153	-0.08%	1,225	-216	-1,018	339	-277
현대차	127,500	1.59	204.6	58.7	107,167	8,507	0.04%	-2,058	1,741	-127	-2,169	-2,242
기아차	40,550	2.01	58.1	55.7	61,074	-4,410	-0.12%	-6,567	-1,995	8,607	4,358	4,645
NAVER	294,500	0.51	187.2	55.6	52,279	277	0.08%	-739	-5,623	6,421	4,920	-223
SK 하이닉스	85,500	2.52	292.2	52.0	150,889	20,742	0.01%	-3,042	17,017	-14,389	-17,834	-3,817
SK 텔레콤	220,000	1.38	78.5	49.4	28,675	9,276	0.12%	-3,347	5,600	-2,548	888	-4,152
SK 네트워크스	5,050	-2.32	1.5	49.1	9,483	-18,363	-0.04%	7,620	-21,843	14,209	8,248	5,926
LG 이노텍	161,500	0.00	8.7	46.9	20,190	245	-0.70%	289	-388	103	-64	-162

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터