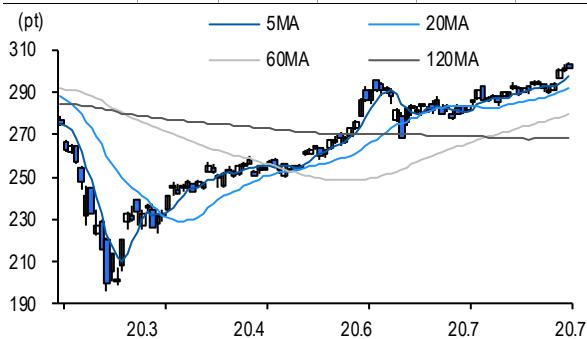


선물옵션시장 지표

2020.7.31

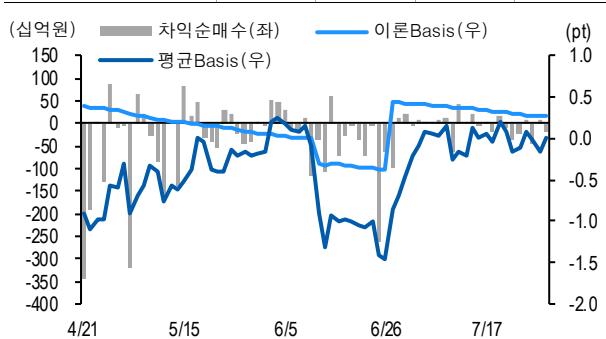
Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	0.27	0.01	-0.05	-0.09%
베이시스(mini)	0.09	0.00	-0.01	-0.03%
제1스프레드(SP)	-0.06	-0.50	-0.50	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.09	-0.06	-0.06	-0.05%



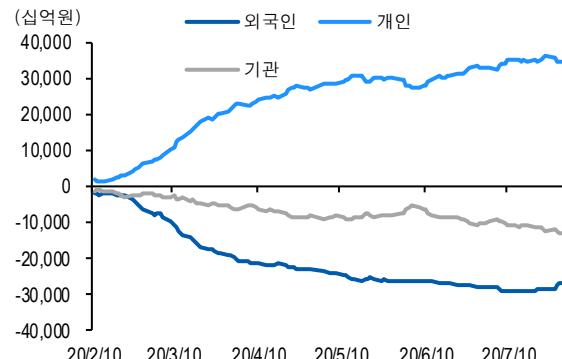
투자주체별 매매 동향

(십억원)

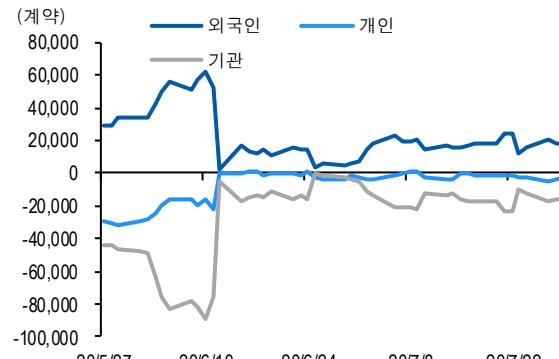
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	224.4	-6.1	218.3	0.2	54.8	-67.9	-5.7	0.4	0.4	-8.5
개인	6.9	-22.4	-15.5	0.0	-0.3	-12.2	-0.5	-1.1	0.2	-7.5
기관	-234.2	29.9	-204.4	-20.4	-180.6	79.2	5.4	0.5	-0.6	13.7
금융투자	42.3	40.0	82.3	0.0	-0.8	248.3	4.3	0.0	-0.1	-16.1
투신	-43.9	-24.6	-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

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

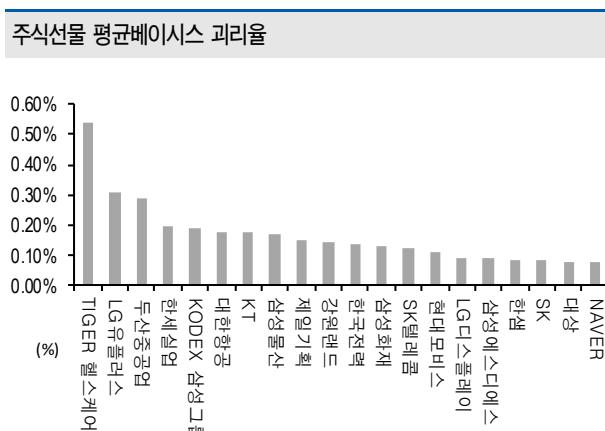
선물옵션시장 지표

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	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정		
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, 유안티증권 리서치센터



자료: KBX 유티즌워리 리서치센터



자료: KBX 유아티즈권 리서치센터

자료: KBX 유티즌워리리서치센터