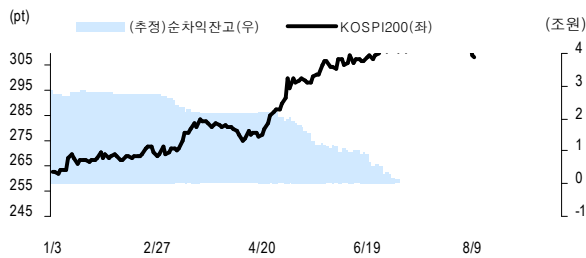


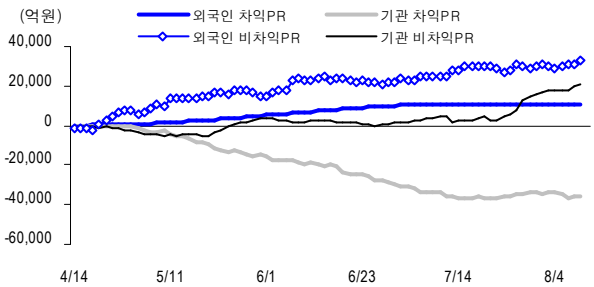
선물옵션시장 지표

2017.8.11

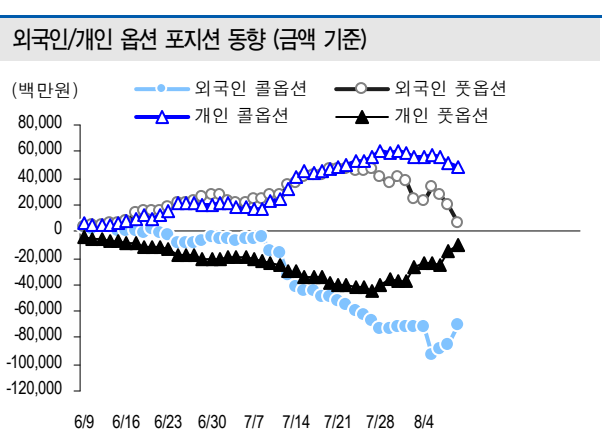
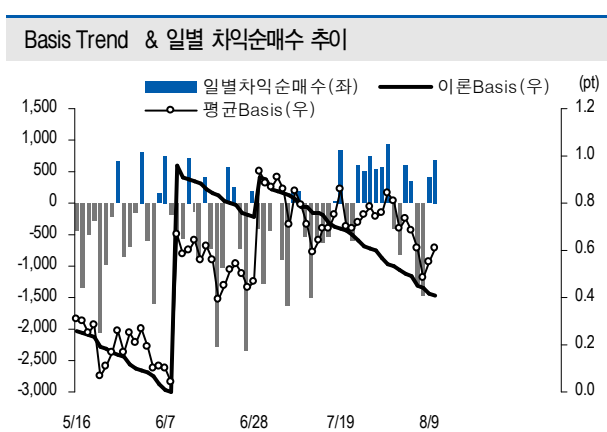
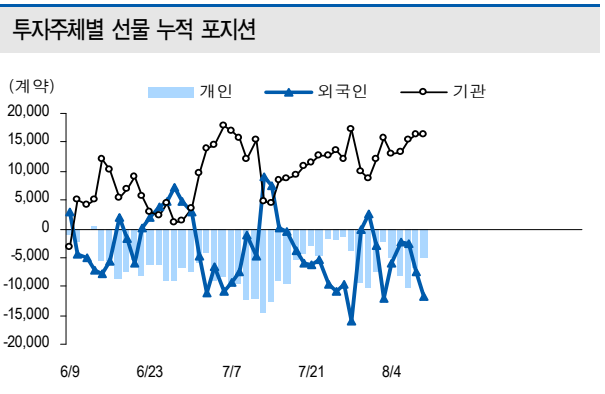
Market Data				
	선물9월물	선물12월물	KOSPI200	KOSPI
전일대비	-1.40	-1.15	-1.15	-8.92
전일비	-0.45%	-0.37%	-0.37%	-0.38%
증가	308.60	309.45	308.37	2,359.47
거래량	375,099	1,008	거래량(천주)	277,743
미결제약정	270,127	42,865	거래대금(억원)	61,706



프로그램 매매 동향 / 주체별 PR 추이 (단위: 억원)			
시장 Basis	0.23	차익순매수	700
평균 Basis	0.61	비차익순매수	3,379
이론 Basis	0.42	제1스프레드(SP)	1
이론가과리율(%)	-0.06	SP 거래량	0
Mini K200 시장 Basis	-0.23	Mini K200 평균 Basis	0.06



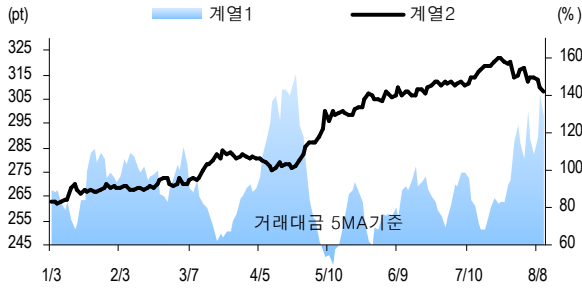
투자주체별 매매동향			
	외국인	개인	기관
현물(억원)	-2,857	-1,697	4,302
선물(계약)	-4,049	1,814	-57
선물 누적	-11,660	-5,077	16,281
콜옵션(계약)	16,993	31,759	-49,623
콜옵션 누적	79,721	304,468	-364,391
풋옵션(계약)	24,279	11,386	-48,328
풋옵션 누적	986,270	-607,921	-331,842



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

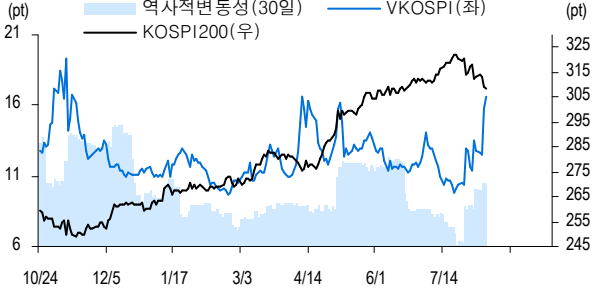
선물옵션시장 지표

Put Call Ratio



	PCR	전일대비	5MA
거래량 기준	117.51	3.07	111.32
거래대금 기준	152.55	-49.52	128.42

Historical Volatility (30일) & VKOSPI



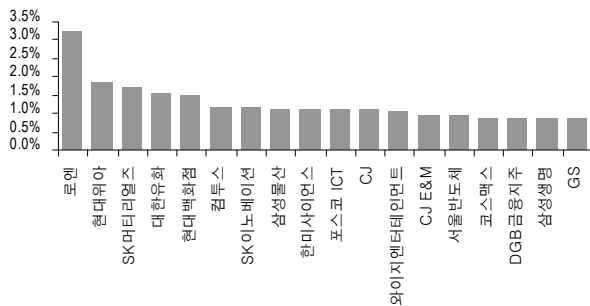
	VKOSPI	H.V	대표 Call I.V	대표 Put I.V
전일	16.55	10.48	8.40	11.80
증감	0.85	-0.09	-6.30	-4.60

주식선물시장 동향 (거래량 상위 10종목)

종목	기초자산			주식선물						거래대금 비율 선물/현물(%)
	가격	등락률	거래대금	가격	등락률	거래대금	거래량	미결제약정	베이스스	
SK 하이닉스	64,400	0.31	285,612	63,800	-0.62	100,339	157,354	0	-600	35.13
미래에셋대우	10,150	-2.87	64,284	10,200	-1.92	10,502	102,870	0	50	16.34
LG 디스플레이	29,350	-1.84	123,593	29,550	-1.34	18,091	61,070	0	200	14.64
LG 전자	73,700	3.22	131,678	73,700	3.51	22,585	30,825	0	0	17.15
삼성전기	92,600	-0.22	95,320	93,000	0.43	13,108	14,212	0	400	13.75
두산인프라코어	8,540	-1.95	22,493	8,580	-1.94	1,023	11,913	0	40	4.55
LG 유플러스	15,650	-3.1	26,065	15,750	-2.17	1,804	11,540	0	100	6.92
삼성전자	2,295,000	-0.82	1,047,045	2,279,000	-1.72	258,047	11,257	0	-16,000	24.65
카카오	108,500	0	86,231	108,500	0	11,781	10,774	0	0	13.66
신한지주	55,400	0.18	74,245	54,900	-1.08	5,870	10,693	0	-500	7.91
			1,956,567			443,149	422,508	0		22.65

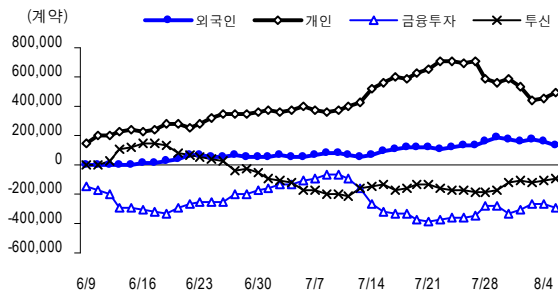
단위: 가격(원), 거래대금(백만원), 베이스스(원) / 등락률 (%) / 거래량, 미결제약정 (계약)

주식선물 베이스스 괴리율



주: 베이스스 괴리율 = 베이스스 / 현물 증가

투자주체별 주식선물 누적 포지션



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터