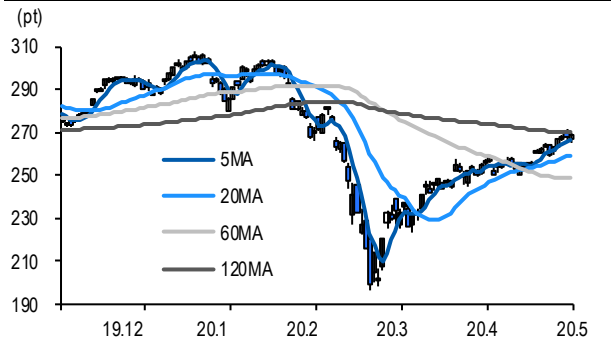
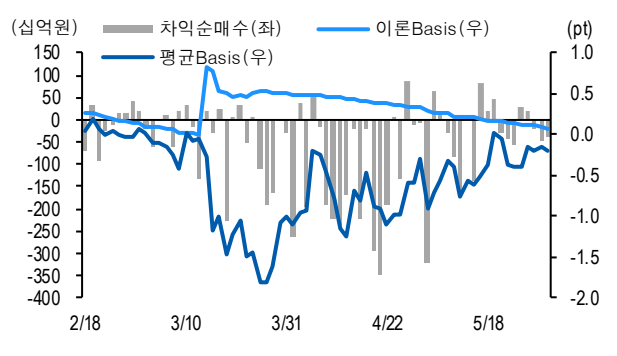


선물옵션시장 지표 2020.6.1

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	268.32	0.01	0.03	9,425.0	-
선물 6월물	267.00	-0.48	-1.30	24,389.6	343,797
선물 9월물	266.35	-0.50	-1.35	154.8	18,287
6월물(mini)	267.10	-0.45	-1.16	1,931.0	125,361
7월물(mini)	266.66	-0.25	-0.66	7.0	9,055

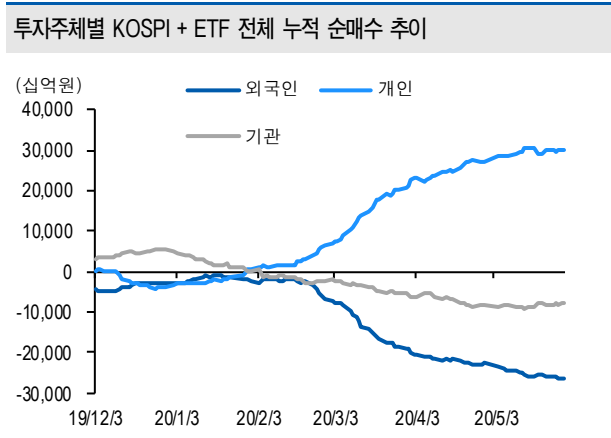


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.08	-0.21	-1.32	-0.11%	
베이스스(mini)	0.08	-0.21	-1.22	-0.11%	
제1스프레드(SP)	-0.29	-0.61	-0.65	-0.12%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	-1.25	-1.25	-0.49%	

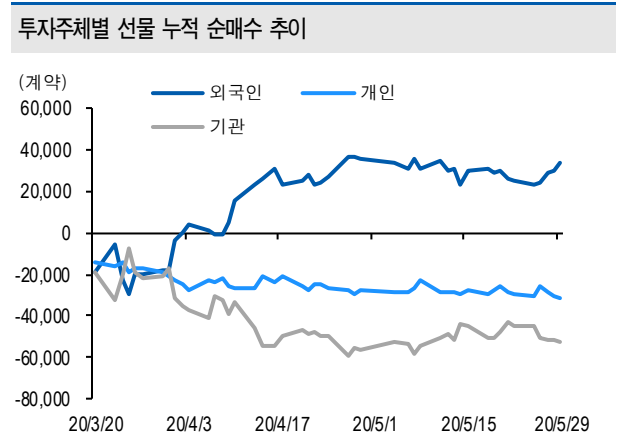


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-199.9	15.3	-184.6	-0.4	-198.0	267.2	-2.4	-2.5	-1.4	1.9
개인	189.8	-80.9	108.9	0.0	-0.2	-77.1	-5.3	3.2	-1.9	-23.5
기관	-20.1	75.0	54.9	-38.8	-11.0	-195.6	7.7	-0.7	3.1	22.1
금융투자	-43.4	-28.8	-72.2	-9.0	-7.7	-128.7	7.4	-1.0	3.1	-10.1
투신	57.5	96.1	153.6	0.0	10.3	-82.6	0.2	0.3	0.0	-12.6
은행+보험+기타금융	4.0	15.6	19.6	0.0	-10.4	-13.2	0.0	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가자자체	-23.3	-11.9	-35.2	-29.8	-4.1	28.8	0.0	0.0	0.0	45.0
기타법인	30.2	-9.5	20.7	0.0	0.0	5.5	0.0	0.0	0.1	-0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,151,483	373.5	864,751	18.6%	지수옵션 전체	2,289,798	785.5	2,205,410
Put	1,138,315	412.0	1,340,659	27.6%	PCR(금액기준)	1.10	VKOSPI	25.64%(+0.40%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	275.0(K+3)	1.49	-0.37	197,943	29,782	4,875	18.6	Put	270.0(K+1)	6.16	0.58	6,267	12,152	1,658	25.3
	272.5(K+2)	2.24	-0.49	117,445	19,604	260	18.7		267.5(K+0)	4.90	0.45	21,350	6,234	357	25.5
	270.0(K+1)	3.26	-0.59	84,099	32,503	3,347	19.1		265.0(K-1)	3.92	0.36	34,981	10,602	343	26.2
	267.5(K+0)	4.47	-0.75	16,658	17,386	42	19.1		262.5(K-2)	3.12	0.25	45,738	9,134	-105	26.9
	265.0(K-1)	5.97	-0.87	7,810	16,636	164	19.4		260.0(K-3)	2.52	0.21	73,627	20,255	969	28.0

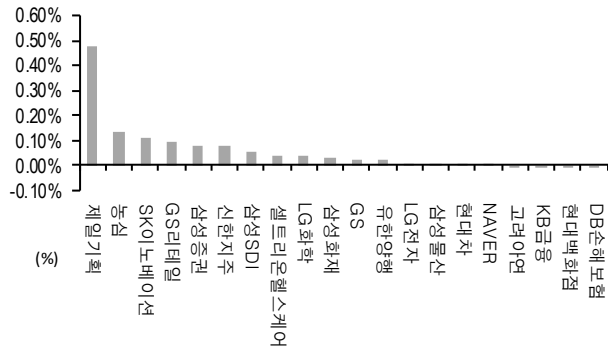
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,708,913	2,566.2	4,790,806	-104,830	-2,623	-37,711	41,647	1.9	-23.5	22.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	391,000	0.39	170.9	83.8	23,097	555	0.04%	424	-358	-45	-102	-185
삼성 SDI	361,500	0.70	209.6	79.4	32,781	212	0.06%	-130	708	-650	-592	-350
LG 전자	58,800	0.17	31.3	59.4	38,689	-1,402	0.01%	2,152	-2,618	470	529	509
현대차	98,300	1.03	106.0	53.8	99,309	5,303	0.00%	1,387	947	-2,329	917	-1,918
카카오	260,000	-2.26	214.7	49.9	41,099	-4,131	-0.38%	-1,166	-35	1,158	36	3,705
기아차	34,200	6.71	79.2	46.8	73,801	1,294	-0.03%	2,174	-5,989	3,892	6,877	801
LG 이노텍	147,000	2.08	23.3	46.6	19,371	1,992	-0.07%	-218	424	-225	915	-1,385
엔씨소프트	787,000	-0.38	37.9	44.7	2,427	-485	-0.16%	-111	14	98	-173	283
대림산업	92,400	7.57	42.6	43.9	15,068	3,366	-0.02%	507	1,239	-1,953	-527	-2,576
SK 하이닉스	81,700	-2.51	240.4	43.1	213,784	-25,434	-0.03%	-4,515	-4,838	9,254	-181	16,598

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터