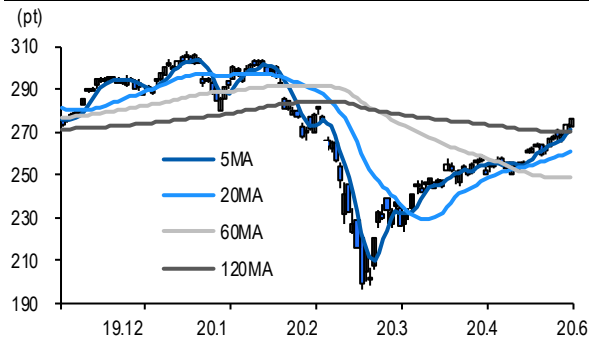


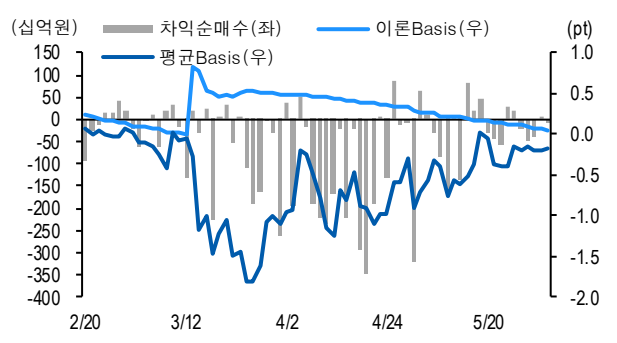


선물옵션시장 지표 2020.6.3

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	276.08	1.06	2.89	6,827.3	-
선물 6월물	275.80	1.03	2.80	18,214.1	345,511
선물 9월물	275.15	1.01	2.75	268.5	22,687
6월물(mini)	275.78	1.02	2.58	1,527.9	133,988
7월물(mini)	275.08	1.03	2.80	6.4	9,274

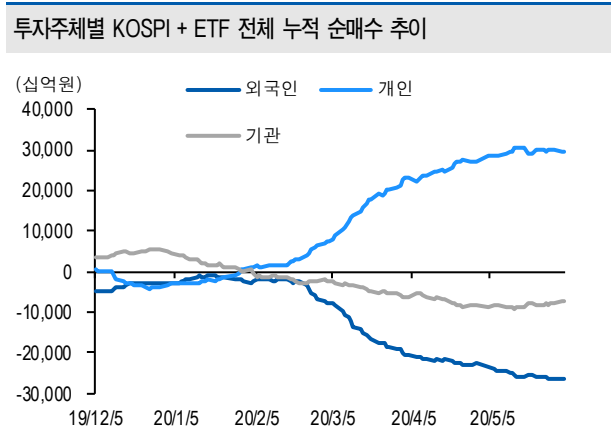


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.06	-0.17	-0.28	-0.08%	
베이스스(mini)	0.06	-0.17	-0.30	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.28	-0.65	-0.65	-0.13%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.06	-0.25	-0.25	-0.11%	

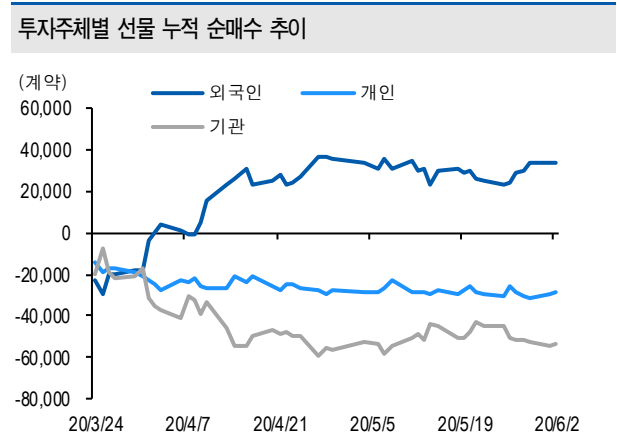


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-46.0	-4.4	-50.4	0.0	-51.2	-22.1	-30.5	0.0	-8.8	14.7
개인	-10.3	-40.2	-50.5	0.0	0.4	44.2	-1.5	1.7	3.0	-5.3
기관	34.3	39.7	74.0	-6.7	-20.1	-90.8	32.8	-1.2	6.0	-8.4
금융투자	-4.5	77.9	73.4	-9.6	0.2	36.4	32.6	-2.0	5.9	8.7
투신	-19.9	-16.3	-36.2	0.0	-27.4	-95.3	0.2	0.6	0.1	-19.6
은행+보험+기타금융	42.2	-14.0	28.2	0.0	22.5	-20.0	0.0	0.1	0.0	2.6
연기금+국가자자체	-8.6	1.4	-7.2	2.9	-16.9	-11.9	0.0	0.0	0.0	-0.1
기타법인	22.0	4.9	26.8	0.0	-1.4	68.7	-0.9	-0.4	-0.1	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,249,959	375.9	900,322	21.0%	지수옵션 전체	2,180,966	600.7	2,347,406
Put	931,007	224.9	1,447,084	27.5%	PCR(금액기준)	0.60	VKOSPI	25.00%(+0.06%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	280.0(K+3)	2.21	0.67	175,293	32,353	-3,959	20.9	Put	275.0(K+1)	3.81	-1.47	16,692	10,350	4,035	23.9
	277.5(K+2)	3.24	0.91	89,662	18,598	-1,177	21.2		272.5(K+0)	2.90	-1.20	23,860	5,339	2,805	24.8
	275.0(K+1)	4.56	1.23	46,982	25,727	-2,596	21.8		270.0(K-1)	2.23	-0.92	51,056	21,325	4,642	25.9
	272.5(K+0)	6.23	1.58	11,447	19,853	-902	23.0		267.5(K-2)	1.73	-0.70	51,363	11,728	4,666	27.2
	270.0(K-1)	8.01	1.79	10,468	28,667	-1,324	23.6		265.0(K-3)	1.37	-0.51	73,664	19,768	4,910	28.7

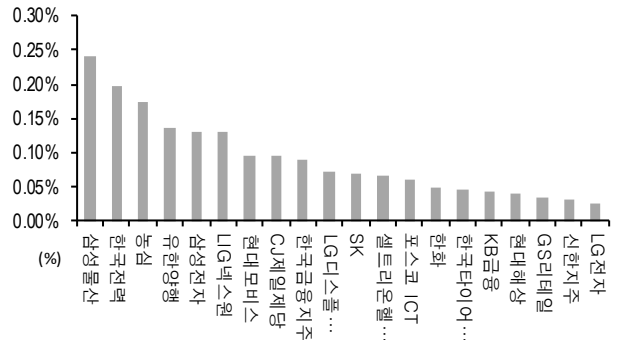
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,753,181	2,078.4	5,059,709	172,528	68,245	-56,279	10,990	14.7	-5.3	-8.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아차	36,450	5.65	82.6	72.9	69,777	6,715	-0.07%	-4,487	19	4,216	5,862	-4,030
삼성 SDI	370,000	0.82	186.1	72.0	31,166	-2,357	0.02%	-53	590	-686	-2,210	1,762
LG 화학	395,500	-0.25	106.5	68.8	21,050	-2,686	0.00%	343	-578	235	-578	2,162
SK 하이닉스	83,400	-0.36	158.6	61.7	235,640	860	0.01%	-3,228	8,373	-5,178	-628	-701
LG 이노텍	154,500	1.64	26.7	61.5	21,631	-2,706	-0.17%	-347	-111	526	-1,131	1,817
삼성전기	126,500	0.00	35.0	54.6	37,854	-1,780	-0.21%	-1,699	-26	1,726	-88	2,351
한국금융지주	55,700	0.91	11.8	53.2	25,600	2,061	0.09%	479	-37	-442	-2,143	-2,010
삼성전자	51,400	0.39	366.1	51.9	1,615,032	-5,084	0.13%	25,434	-14,183	-10,947	-5,441	-1,957
엔씨소프트	812,000	-0.61	28.1	51.5	2,414	-86	-0.06%	-67	76	-9	57	-166
대림산업	97,500	4.06	31.4	49.5	12,372	-475	-0.02%	46	-2,442	2,471	2,329	-911

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터