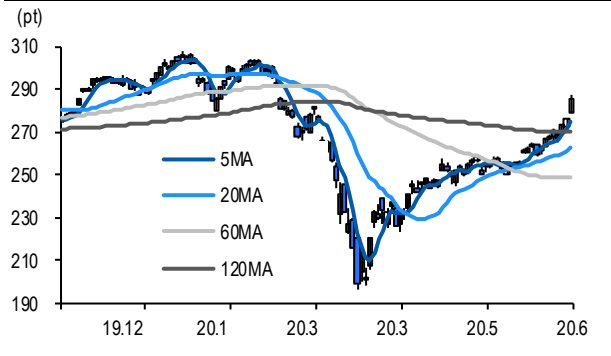


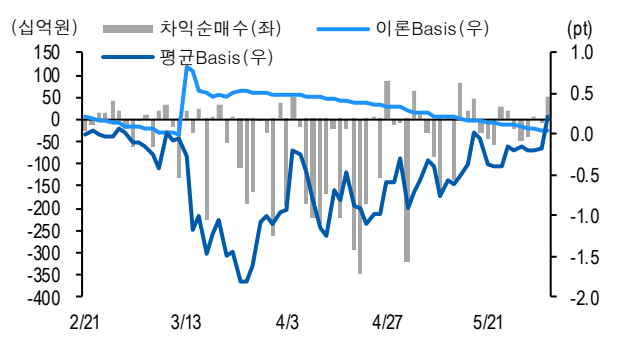


선물옵션시장 지표 2020.6.4

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	285.91	3.56	9.83	13,222.5	-
선물 6월물	286.25	3.79	10.45	28,870.0	344,332
선물 9월물	285.50	3.76	10.35	476.3	26,123
6월물(mini)	286.32	3.81	10.54	3,183.9	138,747
7월물(mini)	285.30	3.72	10.22	17.5	9,367

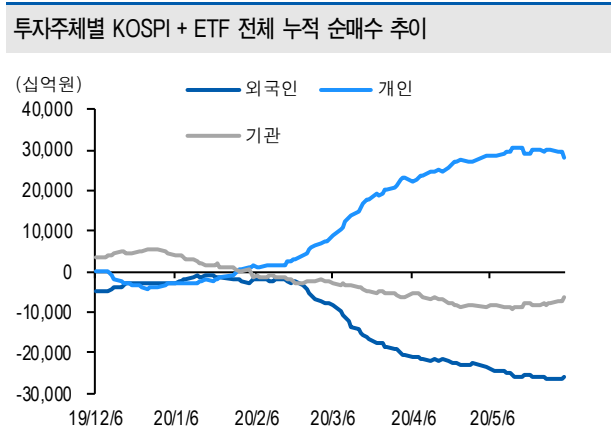


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.05	0.21	0.34	0.06%	
베이스(mini)	0.05	0.20	0.41	0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.27	-0.65	-0.65	-0.13%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.30	0.30	0.09%	

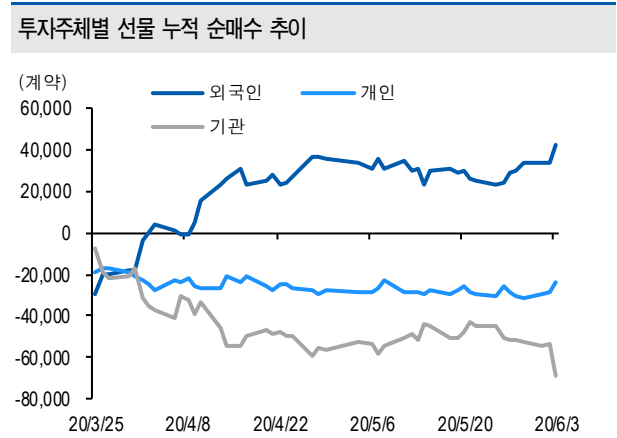


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	205.0	0.0	205.1	23.8	174.7	-106.9	764.6	23.9	-6.1	5.6
개인	-1,318.7	-25.6	-1,344.3	0.0	1.2	317.4	8.8	-5.7	3.1	5.8
기관	1,148.3	29.9	1,178.2	27.6	-234.0	-257.9	-772.1	-18.2	3.7	-10.2
금융투자	1,037.9	164.1	1,202.0	0.0	5.7	-788.9	-769.2	-20.8	3.7	-67.6
투신	96.6	-33.1	63.6	8.9	-18.4	413.4	-2.8	3.0	-0.1	23.8
은행+보험+기타금융	60.3	-103.8	-43.4	-0.6	-16.9	191.8	0.0	-0.5	0.0	-0.9
연기금+국가자자체	-118.8	1.5	-117.3	19.3	-204.5	-74.3	-0.1	0.0	0.0	34.5
기타법인	-34.7	-4.3	-39.0	0.0	0.1	47.4	-1.3	0.1	-0.7	-1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,554,638	969.4	911,500	26.2%	지수옵션 전체	4,206,020	1,338.7	2,428,431
Put	1,651,382	369.3	1,516,931	29.5%	PCR(금액기준)	0.38	VKOSPI	25.74%(+0.74%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	282.5(K+3)	6.65	5.22	65,554	13,957	-5,709	26.5	Put	277.5(K+1)	1.67	-3.30	68,946	6,222	4,864	26.9
	280.0(K+2)	8.10	5.89	74,331	23,450	-8,903	25.4		275.0(K+0)	1.29	-2.52	102,579	17,983	7,633	28.2
	277.5(K+1)	10.40	7.16	19,093	15,467	-3,131	28.8		272.5(K-1)	0.98	-1.92	115,291	13,850	8,511	29.4
	275.0(K+0)	12.50	7.94	7,069	23,855	-1,872	30.2		270.0(K-2)	0.77	-1.46	142,888	29,669	8,344	30.8
	272.5(K-1)	14.50	8.27	4,165	18,300	-1,553	29.9		267.5(K-3)	0.58	-1.15	108,098	13,350	1,622	31.8

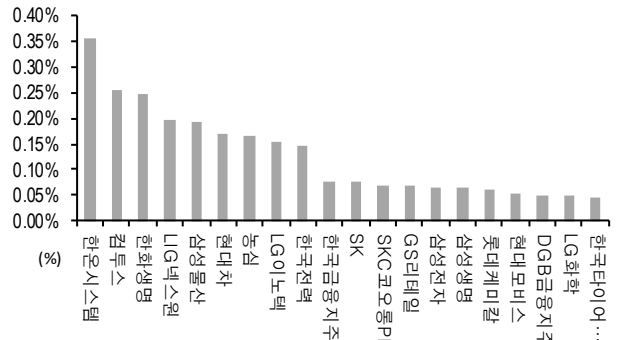
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	6,424,117	3,721.0	5,214,007	154,298	7,619	-34,053	32,431	5.6	5.8	-10.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아차	36,800	0.96	82.8	58.8	58,018	-11,759	-0.06%	582	3,600	-3,600	-1,322	3,256
삼성 SDI	367,000	-0.81	203.0	58.3	29,264	-1,902	0.04%	749	177	-940	-1,455	1,289
LG 이노텍	153,000	-0.97	17.5	54.9	21,695	64	0.15%	150	41	-162	822	-677
LG 화학	401,000	1.39	96.9	51.3	20,626	-424	0.05%	394	91	-478	-850	668
SK 하이닉스	88,900	6.59	515.8	51.1	252,557	16,917	0.04%	8,800	-18,442	9,233	-17,667	2,834
대림산업	96,500	-1.03	20.6	48.3	12,723	351	0.03%	-108	969	-908	-49	-630
삼성전자	54,500	6.03	1,199.4	45.4	1,668,220	53,188	0.07%	-27,586	52,763	-23,112	-77,781	34,635
엔씨소프트	793,000	-2.34	37.9	39.5	2,379	-35	-0.04%	98	-12	-90	-116	85
KB 금융	38,550	6.34	76.4	38.0	126,029	-6,716	0.01%	-254	-4,908	4,293	-3,038	9,301
현대차	108,500	5.34	122.2	36.5	108,780	7,219	0.17%	-1,815	420	1,362	2,687	-5,937

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터