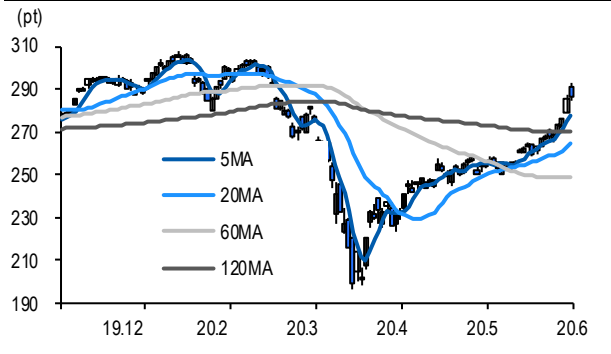
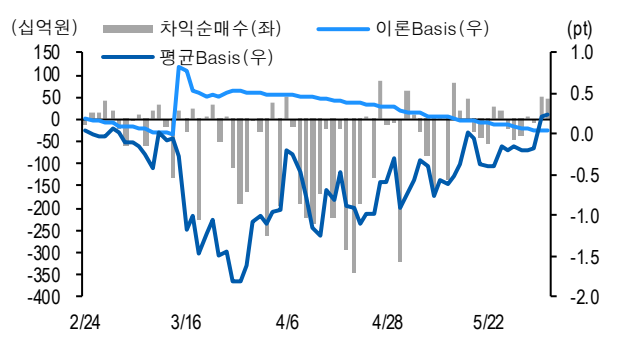


선물옵션시장 지표 2020.6.5

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	286.45	0.19	0.54	11,421.5	-
선물 6월물	286.40	0.05	0.15	30,634.5	335,485
선물 9월물	285.90	0.14	0.40	570.3	38,522
6월물(mini)	286.42	0.06	0.10	3,080.0	136,367
7월물(mini)	286.12	0.29	0.82	25.3	10,390

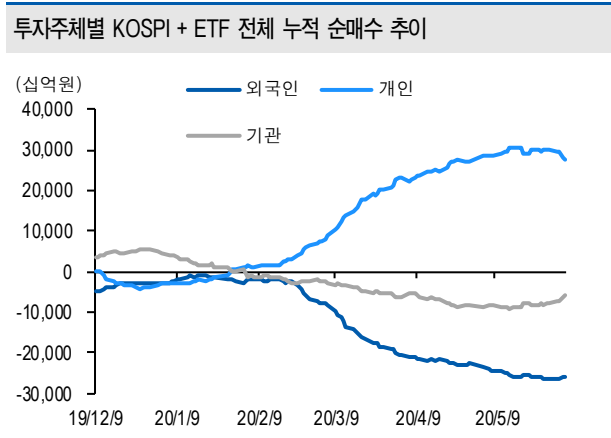


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.04	0.25	-0.05	0.07%	
베이스스(mini)	0.04	0.25	-0.03	0.07%	
제1스프레드(SP)	-0.26	-0.50	-0.45	-0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	-0.04	-0.04	-0.03%	

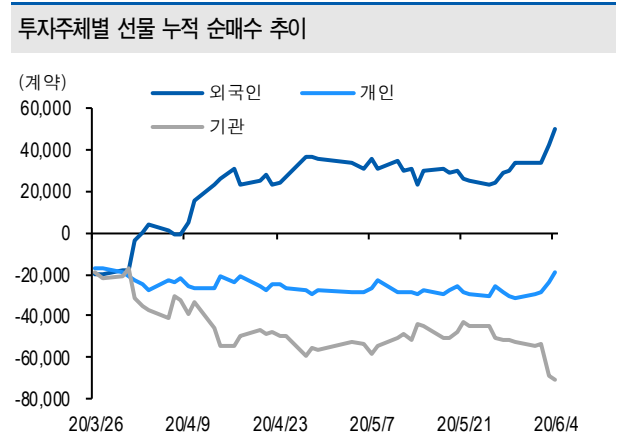


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	45.6	16.9	62.5	2.9	108.3	136.1	399.8	3.2	-1.4	18.8
개인	-334.7	27.8	-306.9	0.0	0.6	321.6	13.7	2.5	-3.1	8.2
기관	297.9	-57.2	240.8	44.5	-200.0	-501.9	-413.8	-5.8	4.3	-29.1
금융투자	478.4	86.8	565.2	0.0	-7.4	-129.8	-414.3	-6.1	5.0	-20.2
투신	-82.5	-63.4	-145.9	4.3	-47.5	-299.1	0.5	0.3	-0.2	-15.9
은행+보험+기타금융	-63.1	-77.5	-140.6	4.1	-51.5	-32.5	0.0	0.0	0.0	0.3
연기금+국가자자체	-91.0	-1.7	-92.7	-9.5	-106.1	-40.5	0.0	0.0	-0.4	6.7
기타법인	-8.8	12.4	3.6	0.0	0.6	44.2	0.3	0.1	0.1	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,727,728	597.0	983,679	26.7%	지수옵션 전체	3,568,123	1,113.5	2,559,101
Put	1,840,395	516.5	1,575,422	28.7%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	25.69%(-0.05%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	292.5(K+3)	2.18	0.12	83,362	16,625	1,751	26.7	Put	287.5(K+1)	5.07	-0.05	37,342	3,956	2,649	26.9
	290.0(K+2)	2.98	0.18	66,099	19,713	-3,519	26.5		285.0(K+0)	3.87	-0.04	92,076	8,570	2,305	27.2
	287.5(K+1)	3.98	0.26	19,951	12,716	177	26.3		282.5(K-1)	2.94	-0.03	123,186	9,626	4,267	27.8
	285.0(K+0)	5.28	0.20	9,361	15,564	-185	26.6		280.0(K-2)	2.21	0.01	147,307	18,149	4,002	28.5
	282.5(K-1)	6.84	0.19	5,110	14,083	126	27.2		277.5(K-3)	1.65	-0.02	159,238	11,737	5,515	29.4

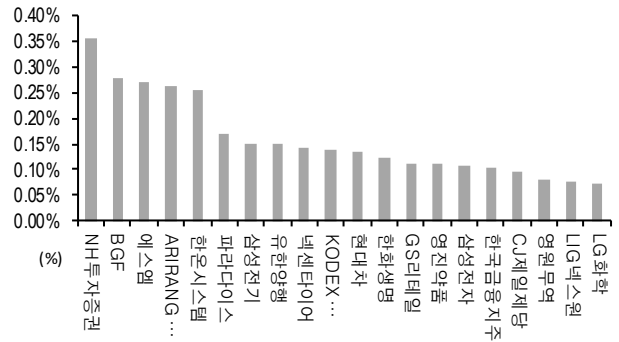
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	7,133,087	4,338.3	5,418,893	204,886	-13,737	59,832	-48,158	18.8	8.2	-29.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	370,500	0.95	250.6	87.1	29,714	450	0.06%	101	618	-736	-180	-533
SK 하이닉스	88,000	-1.01	463.7	78.0	240,362	-12,195	0.04%	1,352	-3,846	2,475	-182	7,319
기아차	36,150	-1.77	61.4	61.8	58,859	841	-0.01%	7,347	6,186	-13,873	-5,052	-4,291
대림산업	92,800	-3.83	19.7	60.6	11,327	-1,396	-0.01%	994	1,412	-2,433	-1,229	-244
삼성전자	55,000	0.92	1,340.9	60.1	1,580,631	-87,589	0.11%	16,451	23,619	-42,468	-47,543	14,697
LG 화학	418,500	4.36	238.4	59.7	24,857	4,231	0.07%	484	1,601	-2,069	406	-3,028
LG 이노텍	153,500	0.33	17.0	59.5	22,127	432	0.03%	482	-37	-427	-308	169
엔씨소프트	795,000	0.25	47.9	57.7	2,558	179	-0.04%	323	25	-346	65	-399
LG 전자	62,000	-0.64	27.4	47.4	33,403	-3,615	-0.08%	764	-3,937	3,161	1,682	2,849
삼성전기	132,000	1.54	50.0	46.8	42,025	4,042	0.15%	4,775	-1,037	-3,735	-994	-3,263

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터