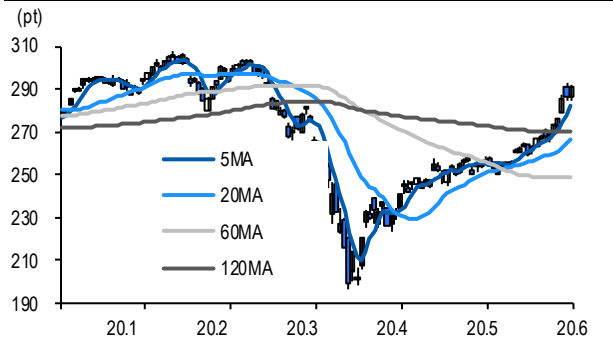
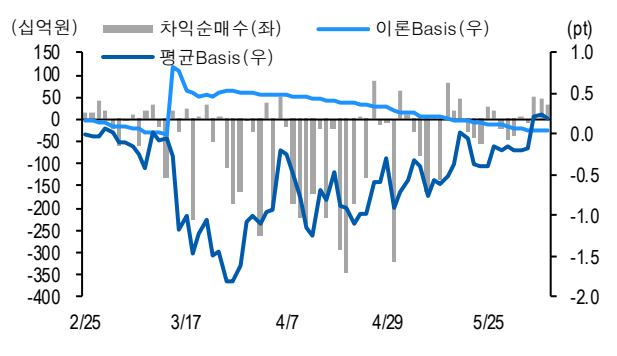


선물옵션시장 지표 2020.6.8

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	290.62	1.46	4.17	9,426.1	-	
선물 6월물	291.55	1.80	5.15	22,299.2	336,287	
선물 9월물	291.20	1.85	5.30	1,157.8	48,165	
6월물(mini)	291.60	1.82	5.18	2,305.7	134,358	
7월물(mini)	291.14	1.75	5.02	15.3	12,876	

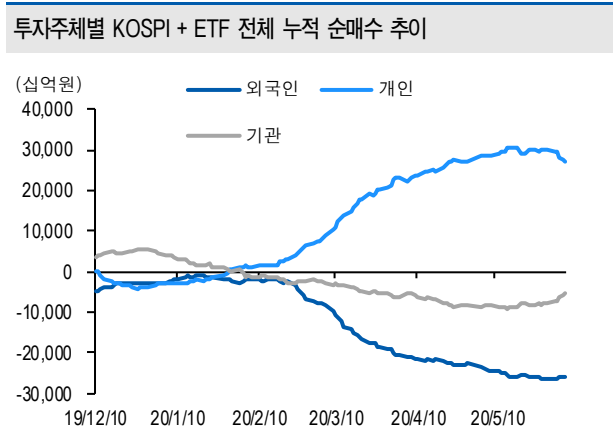


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.04	0.18	0.93	0.05%	
베이스스(mini)	0.04	0.17	0.98	0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.26	-0.48	-0.45	-0.08%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	0.98	0.98	0.32%	

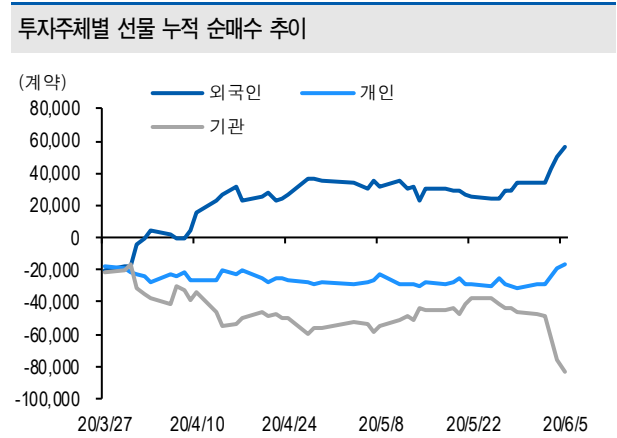


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-68.6	-15.3	-83.9	0.8	-62.5	205.7	238.1	4.6	-5.2	27.0	
개인	-319.5	-94.7	-414.2	0.0	1.9	207.4	0.2	0.5	2.2	33.5	
기관	405.4	110.7	516.1	31.2	-103.2	-308.1	-237.9	-1.9	4.8	-63.4	
금융투자	363.0	374.2	737.2	0.0	0.2	-141.7	-238.2	-1.9	5.1	-10.3	
투신	-6.4	-132.6	-138.9	0.0	-53.0	-151.9	0.3	0.0	-0.3	-29.8	
은행+보험+기타금융	1.8	-87.4	-85.7	7.2	-11.2	35.4	0.0	0.0	0.0	-1.0	
연기금+국가자차체	30.2	-36.2	-6.0	21.1	-38.0	-49.9	-0.1	0.0	0.0	-22.2	
기타법인	-17.3	-0.7	-18.0	0.0	0.0	-104.9	-0.4	-3.2	-1.8	2.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,959,003	593.3	1,046,552	28.4%	지수옵션 전체	3,326,034	950.9	2,685,040
Put	1,367,031	357.6	1,638,488	26.5%	PCR(금액기준)	0.60	VKOSPI	25.45%(-0.24%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	295.0(K+3)	2.70	1.13	157,362	26,552	-210	28.1	Put	290.0(K+1)	3.42	-3.15	18,281	9,468	2,790	23.3
	292.5(K+2)	3.71	1.53	124,646	16,652	27	28.4		287.5(K+0)	2.44	-2.63	36,163	6,972	3,016	23.9
	290.0(K+1)	5.00	2.02	105,836	27,541	7,828	29.1		285.0(K-1)	1.75	-2.12	56,581	9,959	1,389	24.9
	287.5(K+0)	6.54	2.56	33,978	12,410	-306	30.0		282.5(K-2)	1.25	-1.69	80,952	11,206	1,580	25.9
	285.0(K-1)	8.31	3.03	10,615	15,430	-134	31.3		280.0(K-3)	0.91	-1.30	135,238	21,386	3,237	27.2

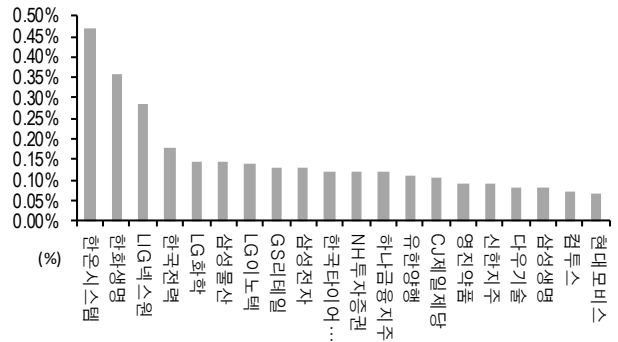
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,470,843	2,877.9	5,570,850	151,957	77,169	42,017	-120,966	27.0	33.5	-63.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	154,500	0.65	30.8	115.8	25,858	3,731	0.14%	476	145	-620	1,170	-3,455
SK 하이닉스	90,400	2.73	273.3	76.2	258,636	18,274	0.05%	830	-3,435	2,089	1,403	-6,821
기아차	36,550	1.11	47.9	73.5	60,526	1,667	0.03%	-1,752	394	1,358	5,091	-3,803
삼성 SDI	373,000	0.67	171.1	71.0	27,768	-1,946	0.01%	-685	-105	195	-546	1,733
삼성전자	55,600	1.09	859.5	68.5	1,476,045	-104,586	0.13%	43,262	11,103	-54,451	-3,911	13,330
엔씨소프트	805,000	1.26	36.2	64.2	2,408	-150	-0.07%	-141	-47	188	142	40
대림산업	94,700	2.05	11.5	61.3	9,896	-1,431	-0.01%	-270	-779	1,039	392	647
LG 화학	435,000	3.94	205.1	55.0	30,103	5,246	0.14%	-1,502	1,722	-227	-1,960	-1,155
현대모비스	219,000	0.00	32.6	52.0	12,266	-881	0.07%	667	1,795	-2,462	-554	-1,122
하나금융지주	31,350	0.48	31.9	51.3	134,757	6,631	0.12%	2,884	1,402	-4,324	229	-7,649

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터