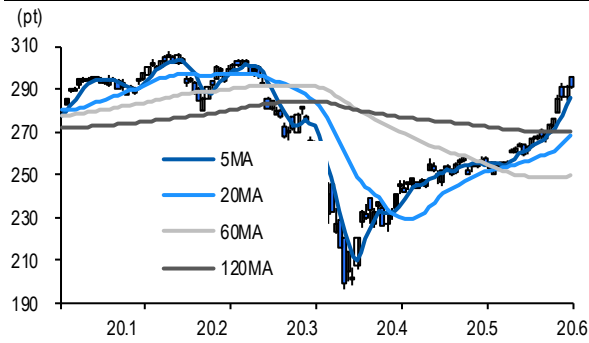


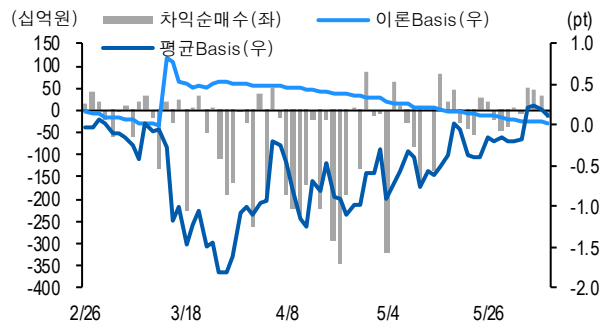
선물옵션시장 지표

2020.6.9

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	290.77	0.05	0.15	9,807.4	-	
선물 6월물	290.70	-0.29	-0.85	27,428.2	295,995	
선물 9월물	291.00	-0.07	-0.20	2,782.6	98,744	
6월물(mini)	290.72	-0.29	-0.88	2,375.7	125,331	
7월물(mini)	289.84	-0.45	-1.30	23.1	13,408	

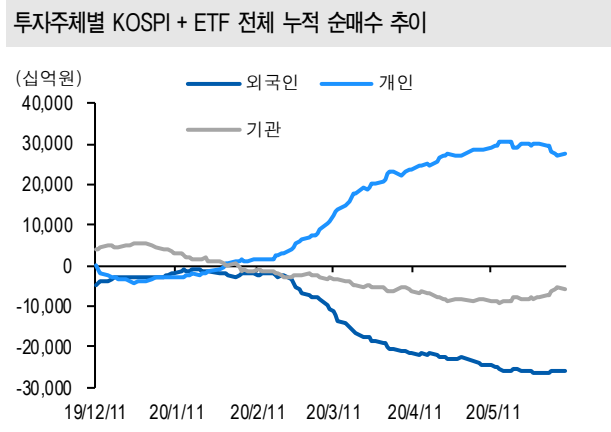


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.02	0.11	-0.07	0.03%	
베이스(mini)	0.02	0.11	-0.05	0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.27	-0.42	-0.35	-0.05%	
합성선물 베이스(ATM)	0.02	-0.06	-0.06	-0.03%	

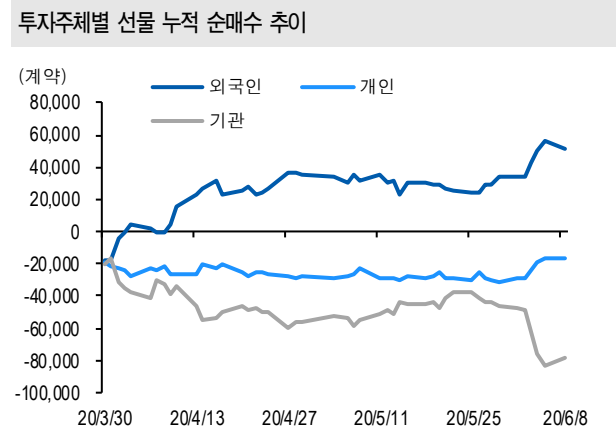


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체	
외국인	7.6	-1.7	5.9	0.0	-36.6	-204.6	-172.8	13.4	-2.6	-1.4	
개인	379.0	-39.3	339.7	0.0	0.0	-25.8	28.1	2.0	2.4	9.6	
기관	-371.6	24.2	-347.4	-15.0	-267.0	199.4	144.0	-9.8	3.4	-5.7	
금융투자	-119.2	201.9	82.8	0.0	-30.2	481.9	144.2	-9.0	2.2	-20.0	
투신	-13.2	-135.0	-148.2	0.0	-35.8	-311.2	-0.3	0.3	-0.2	-15.7	
은행+보험+기타금융	-50.9	-28.0	-79.0	-0.4	-46.2	34.0	0.0	-1.2	1.4	-2.8	
연기금+국가자차체	-193.1	-20.5	-213.6	-14.6	-148.7	-5.2	0.0	0.0	0.0	32.7	
기타법인	-15.0	16.8	1.8	0.0	-1.4	31.0	0.8	-5.5	-3.2	-2.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





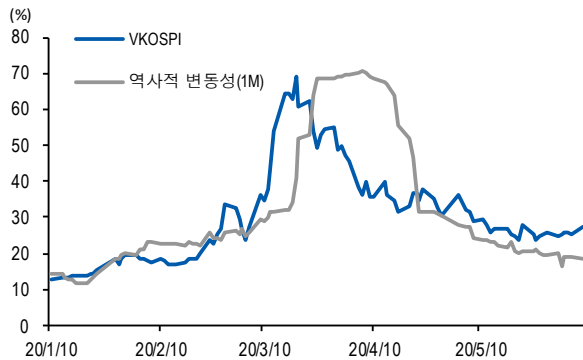
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,763,672	544.4	1,105,738	31.9%	지수옵션 전체	3,634,737	1,019.9	2,814,487
Put	1,871,065	475.5	1,708,749	32.0%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	27.40%(+1.95%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	1.47	-0.48	135,769	22,160	3,475	32.2	Put	292.5(K+1)	4.78	0.13	27,412	5,171	2,846	31.8
	295.0(K+2)	2.14	-0.56	101,686	30,749	4,197	31.8		290.0(K+0)	3.41	-0.01	99,609	15,795	6,327	31.3
	292.5(K+1)	3.00	-0.71	67,754	17,166	514	31.1		287.5(K-1)	2.36	-0.08	138,390	9,440	2,468	31.3
	290.0(K+0)	4.12	-0.88	39,199	21,504	-6,037	30.6		285.0(K-2)	1.60	-0.15	187,010	14,912	4,953	31.8
	287.5(K-1)	5.58	-0.96	8,614	11,670	-740	30.7		282.5(K-3)	1.05	-0.20	199,442	14,764	3,558	32.2

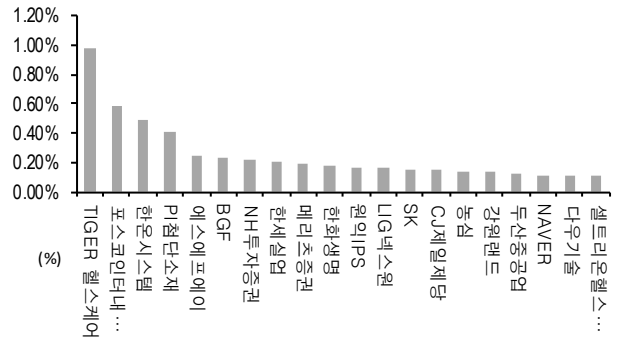
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,898,002	3,194.5	5,537,195	-33,655	-20,049	25,384	-4,740	-1.4	9.6	-5.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	90,900	0.55	335.5	96.8	244,041	-14,595	0.04%	-3,221	-3,496	7,253	-1	6,662
기아차	37,350	2.19	72.0	75.7	30,519	-30,007	-0.01%	-1,798	-3,630	5,237	-4,725	11,904
삼성 SDI	375,000	0.54	190.7	73.6	26,676	-1,092	0.04%	127	351	319	246	355
삼성전자	54,900	-1.26	925.0	65.2	1,289,010	-187,035	0.01%	16,830	22,986	-40,947	-16,691	36,417
LG 이노텍	160,000	3.56	23.1	62.9	26,558	700	0.09%	188	-52	-137	-461	-306
LG 화학	434,500	-0.11	186.1	62.1	27,707	-2,396	0.08%	-58	-1,390	1,478	-637	1,795
KB 금융	38,150	0.26	63.5	58.2	82,770	-36,852	-0.05%	-9,431	-1,057	11,036	5,152	9,662
하나금융지주	31,050	-0.96	31.5	55.3	132,889	-1,868	0.02%	-648	224	-71	1,460	-1,453
대림산업	92,200	-2.64	12.1	49.4	9,228	-668	0.02%	799	-437	-322	-92	-66
현대차	113,500	2.25	82.7	44.6	87,339	-10,932	-0.08%	36	-1,425	1,389	-5,137	8,458

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터