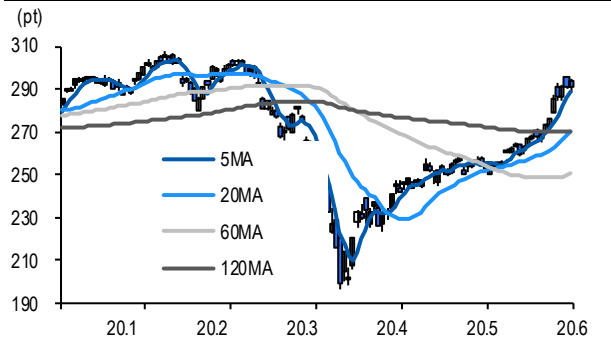


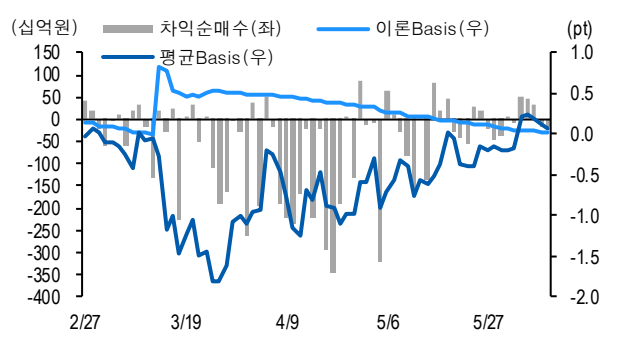


선물옵션시장 지표 2020.6.10

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	291.32	0.19	0.55	10,043.3	-
선물 6월물	290.85	0.05	0.15	26,430.4	230,508
선물 9월물	290.40	-0.21	-0.60	2,596.6	146,091
6월물(mini)	290.94	0.08	0.22	2,459.8	117,188
7월물(mini)	290.38	0.19	0.54	50.6	14,998

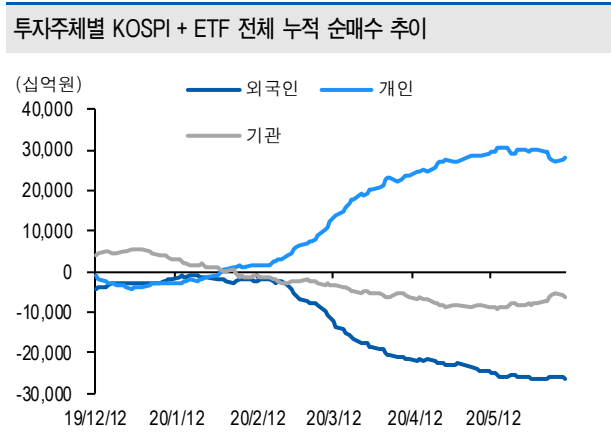


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.01	0.07	-0.47	0.02%	
베이스스(mini)	0.01	0.07	-0.38	0.02%	
제1스프레드(SP)	-0.27	-0.41	-0.50	-0.05%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.43	-0.43	-0.15%	

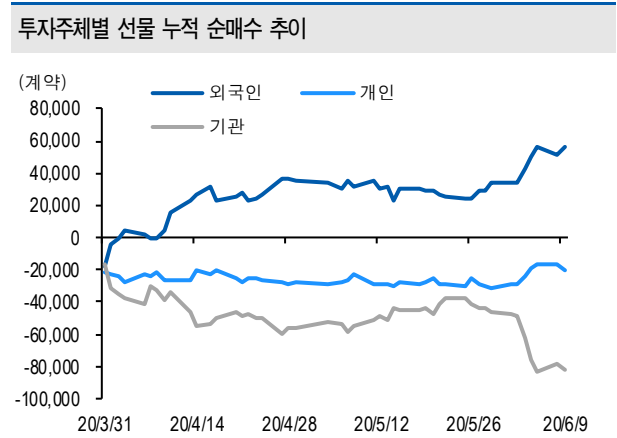


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-21.1	-10.4	-31.5	0.0	4.9	518.2	-128.7	-3.5	4.8	24.5	
개인	412.1	41.9	454.0	0.0	-0.9	-270.4	10.2	8.7	-7.1	-44.8	
기관	-396.7	-32.9	-429.6	-14.5	-138.8	-355.8	117.3	-4.0	2.5	24.0	
금융투자	-182.0	51.6	-130.4	0.0	-13.4	-361.8	117.2	-7.4	2.3	39.0	
투신	-61.0	-59.1	-120.1	0.0	-57.6	3.0	0.0	3.4	-0.1	-63.6	
은행+보험+기타금융	-2.8	-23.3	-26.1	0.0	-5.1	1.2	0.0	0.3	0.0	-0.2	
연기금+국가자재	-148.3	-3.3	-151.6	-34.8	-61.0	1.8	0.0	-0.3	0.3	48.8	
기타법인	5.8	1.4	7.1	0.0	0.2	108.0	1.3	-1.3	-0.2	-3.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,640,789	536.2	1,155,280	28.6%	지수옵션 전체	4,856,186	1,081.4	2,924,697
Put	2,215,397	545.2	1,769,417	30.5%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	26.53%(-0.87%p)

	Call				Put										
	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	297.5(K+3)	0.96	-0.51	294,166	33,333	11,173	29.3	Put	292.5(K+1)	3.90	-0.88	54,319	8,498	3,327	31.1
	295.0(K+2)	1.50	-0.64	203,473	32,268	1,519	28.1		290.0(K+0)	2.53	-0.88	143,719	16,548	753	30.0
	292.5(K+1)	2.30	-0.70	124,456	16,956	-210	26.9		287.5(K-1)	1.56	-0.80	218,340	12,809	3,369	29.7
	290.0(K+0)	3.42	-0.70	87,653	23,019	1,515	25.7		285.0(K-2)	0.93	-0.67	264,936	18,083	3,171	30.0
	287.5(K-1)	4.95	-0.63	14,706	11,925	255	24.8		282.5(K-3)	0.56	-0.49	298,342	16,804	2,040	31.0

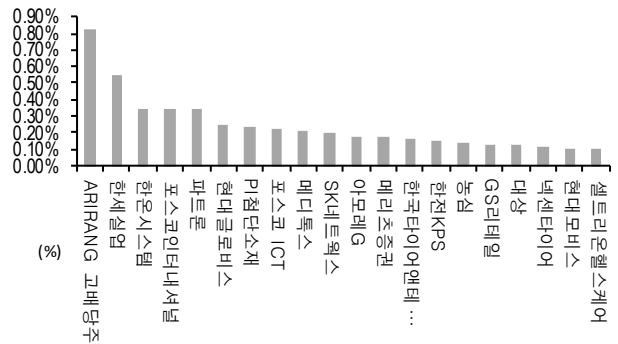
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,976,031	3,231.8	5,569,567	32,372	50,301	-89,567	37,748	24.5	-44.8	24.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	89,900	-1.10	255.3	83.6	224,692	-19,349	0.04%	2,834	8,400	-11,396	-2,168	-6,421
GS 건설	28,350	-2.24	11.3	76.5	31,687	-18,114	-0.56%	-988	17	969	845	117
삼성 SDI	384,000	2.40	281.6	74.4	24,186	-2,490	0.04%	-510	-84	1,876	204	1,439
LG 이노텍	158,000	-1.25	16.5	71.9	25,066	-1,492	-0.11%	104	-200	71	-582	794
삼성전자	55,400	0.91	947.7	71.7	1,042,656	-246,354	-0.01%	19,247	-92,139	71,678	96,204	49,234
대림산업	92,600	0.43	13.9	65.4	8,654	-574	0.03%	-685	1,523	-714	-1,574	860
기아차	36,550	-2.14	51.0	64.0	31,352	833	-0.07%	2,002	-1,586	-416	7,727	670
하나금융지주	31,050	0.00	33.3	64.0	129,197	-3,692	0.03%	-962	481	474	5,645	-721
LG 화학	433,000	-0.35	166.2	63.3	26,121	-1,586	0.09%	771	236	-1,018	-682	-312
현대차	112,000	-1.32	81.9	48.9	80,275	-7,064	-0.13%	1,758	-2,104	346	-984	3,502

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터