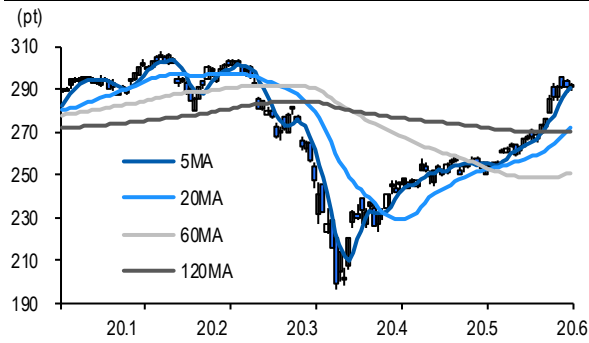


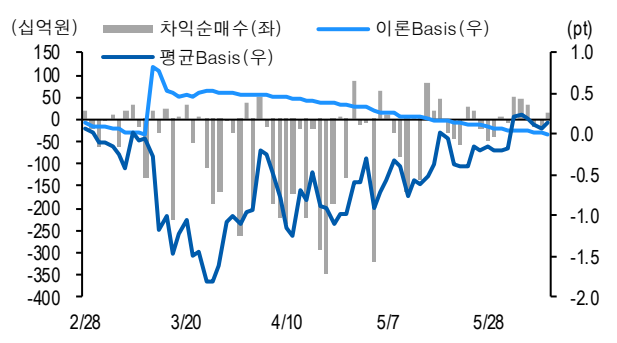


선물옵션시장 지표 2020.6.11

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	291.90	0.20	0.58	8,425.0	-
선물 6월물	291.50	0.22	0.65	18,673.3	167,299
선물 9월물	290.95	0.19	0.55	3,688.4	214,251
6월물(mini)	291.22	0.12	0.28	1,876.3	115,423
7월물(mini)	290.80	0.14	0.42	145.9	20,960

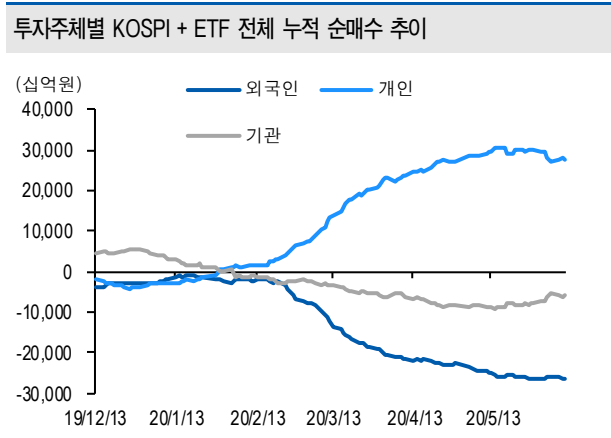


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.01	0.15	-0.40	0.05%	
베이스스(mini)	0.01	0.15	-0.68	0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.26	-0.59	-0.65	-0.11%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.36	-0.36	-0.13%	

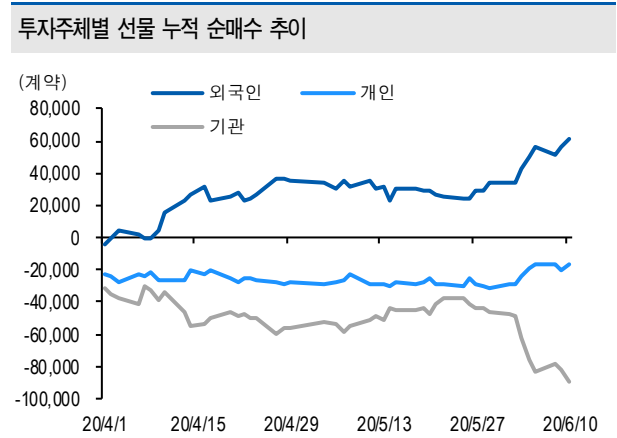


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	-49.2	3.5	-45.8	0.0	91.0	258.9	107.1	0.0	2.7	-18.2
개인	-168.6	-80.5	-249.1	0.0	-0.2	296.2	-6.6	-4.3	-2.8	105.5
기관	219.9	73.3	293.1	14.3	-74.3	-465.5	-100.3	7.9	2.5	-89.7
금융투자	245.9	42.9	288.8	0.0	16.8	-404.4	-100.3	1.6	2.4	-41.8
투신	28.2	8.4	36.6	0.0	-22.7	30.6	0.0	0.6	-0.1	-15.5
은행+보험+기타금융	-13.4	7.5	-5.9	2.7	-10.7	-54.3	0.0	5.8	0.2	-3.6
연기금+국가자자체	-26.5	14.4	-12.1	10.1	-54.7	-37.5	0.0	0.0	0.0	-28.8
기타법인	-2.0	3.7	1.8	0.0	0.1	-89.6	-0.1	-3.6	-2.3	2.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





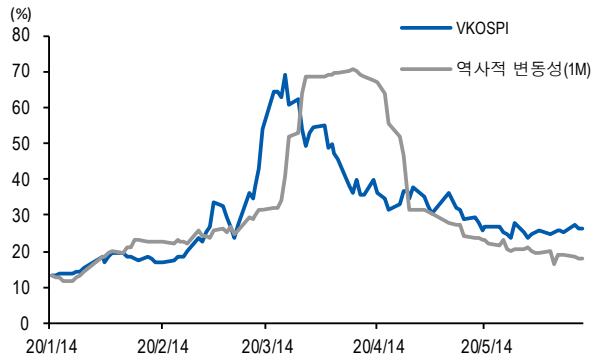
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,223,965	431.6	1,198,727	26.1%	지수옵션 전체	3,812,663	710.1	3,067,256
Put	1,588,698	278.5	1,868,529	28.1%	PCR(금액기준)	0.65	VKOSPI	26.06%(-0.47%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	0.22	-0.37	325,112	51,831	4,366	26.6	Put	295.0(K+1)	4.47	-1.12	10,052	5,695	576	30.5
	297.5(K+2)	0.54	-0.42	365,833	35,748	2,415	27.0		292.5(K+0)	2.78	-1.12	68,514	13,953	5,455	28.7
	295.0(K+1)	1.05	-0.45	232,104	36,759	4,491	26.2		290.0(K-1)	1.54	-0.99	145,548	20,857	4,309	27.6
	292.5(K+0)	1.82	-0.48	201,923	18,033	1,077	24.3		287.5(K-2)	0.75	-0.81	201,435	18,248	5,439	27.1
	290.0(K-1)	3.11	-0.31	81,247	24,416	1,397	23.4		285.0(K-3)	0.35	-0.58	281,173	22,910	4,827	27.6

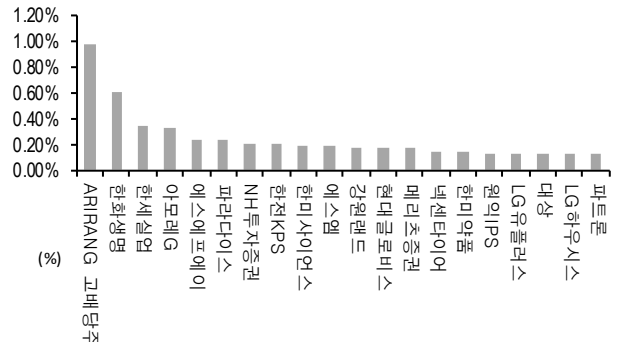
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,265,943	2,987.2	5,628,531	58,964	-2,570	130,196	-126,941	-18.2	105.5	-89.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	90,800	1.00	235.7	86.0	213,188	-11,504	0.02%	-1,600	1,174	903	-711	1,619
삼성 SDI	387,000	0.78	154.0	85.0	21,972	-2,214	0.06%	-494	953	-1,178	-70	-1,199
카카오	262,500	2.94	257.8	62.8	32,864	-107	0.10%	-663	10,499	-10,036	-3,645	-6,792
기아차	36,100	-1.23	34.9	60.5	31,966	614	-0.06%	5,861	2,972	-8,956	-4,399	-1,880
삼성전자	55,400	0.00	500.2	54.1	839,919	-202,737	-0.03%	-20,420	55,812	-33,882	-8,055	-1,025
NAVER	243,500	2.31	176.6	50.7	36,366	5,962	0.11%	-481	7,720	-7,218	-2,891	-5,209
LG 화학	441,000	1.85	117.4	50.1	23,429	-2,692	0.11%	-724	514	191	647	-419
대림산업	93,000	0.43	11.5	49.0	7,483	-1,171	0.04%	-671	327	377	231	133
엔씨소프트	821,000	2.88	51.2	48.9	2,058	-84	-0.02%	-282	192	31	-65	-93
대한항공	20,750	-1.66	14.3	48.3	68,402	-19,505	-0.08%	2,162	4,534	-6,696	-5,387	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터