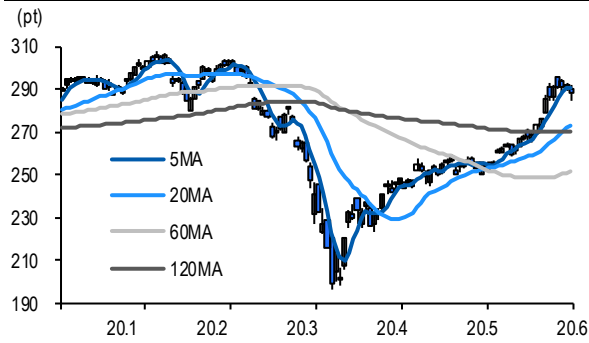


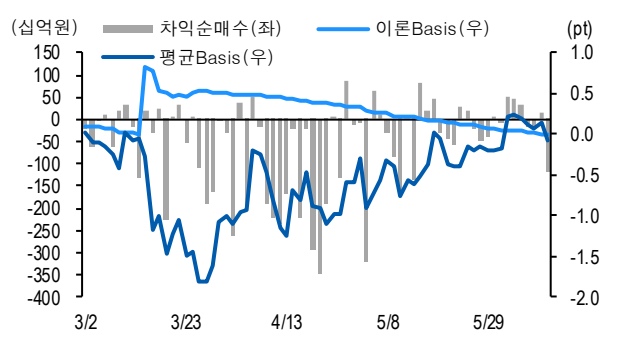


선물옵션시장 지표 2020.6.12

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	288.62	-1.12	-3.28	11,598.5	-
선물 6월물	285.70	-1.99	-5.80	18,440.6	0
선물 9월물	286.30	-1.60	-4.65	17,037.1	269,664
6월물(mini)	286.00	-1.89	-5.22	1,785.6	0
7월물(mini)	286.18	-1.59	-4.62	1,113.4	33,833

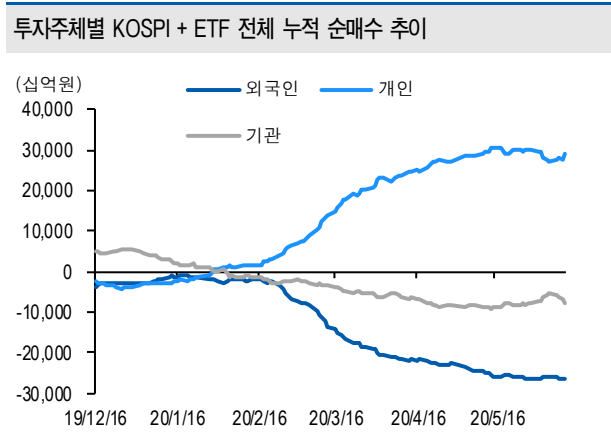


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.00	-0.08	-2.92	-0.03%	
베이스(mini)	0.00	-0.08	-2.62	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.28	-0.71	-0.80	-0.15%	
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-2.81	-2.81	-0.97%	

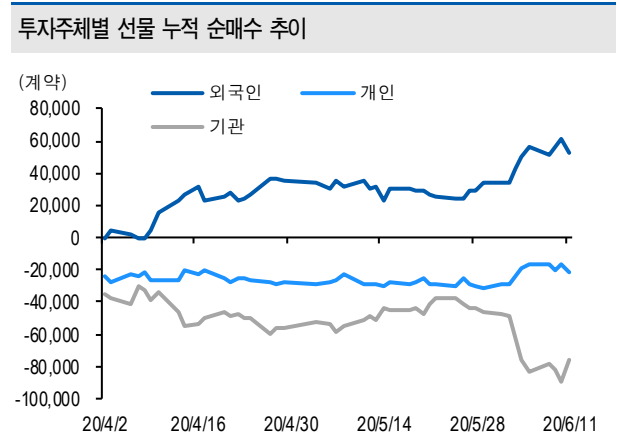


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-117.0	8.8	-108.1	0.0	1.2	324.0	-981.9	-12.3	-6.0	-32.4	
개인	1,269.7	23.9	1,293.6	0.0	-0.4	-455.4	23.4	-2.1	6.2	-22.9	
기관	-1,182.7	-22.2	-1,204.9	-116.9	-159.9	34.6	958.0	14.3	-0.9	56.0	
금융투자	-738.4	-14.5	-752.9	-52.4	-30.4	546.7	957.3	6.4	-1.3	47.5	
투신	3.9	-2.7	1.2	0.0	27.8	-520.3	0.6	3.9	1.2	4.5	
은행+보험+기타금융	-71.9	-15.7	-87.7	0.2	3.0	-95.0	0.0	4.6	-0.7	1.6	
연기금+국가자재	-298.7	-0.1	-298.8	-64.7	-135.6	103.2	0.1	-0.6	0.0	2.5	
기타법인	30.0	-10.5	19.5	0.0	-0.3	96.9	0.6	0.1	0.7	-0.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,789,545	435.1	498,682	13.2%	지수옵션 전체	5,866,498	977.2	1,323,468
Put	3,076,953	542.1	824,786	34.6%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI	26.79%(+0.73%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	300.0(K+3)	0.01	-0.21	120,794	0	-51,831	29.9	Put	295.0(K+1)	9.29	4.82	11,466	0	-5,695	90.7
	297.5(K+2)	0.01	-0.53	336,205	0	-35,748	24.1		292.5(K+0)	6.70	3.92	102,487	0	-13,953	74.2
	295.0(K+1)	0.01	-1.04	479,286	0	-36,759	18.1		290.0(K-1)	4.31	2.77	329,321	0	-20,857	59.3
	292.5(K+0)	0.01	-1.81	539,150	0	-18,033	11.8		287.5(K-2)	1.86	1.11	621,156	0	-18,248	39.6
	290.0(K-1)	0.01	-3.10	565,729	0	-24,416	5.0		285.0(K-3)	0.31	-0.04	826,742	0	-22,910	24.4

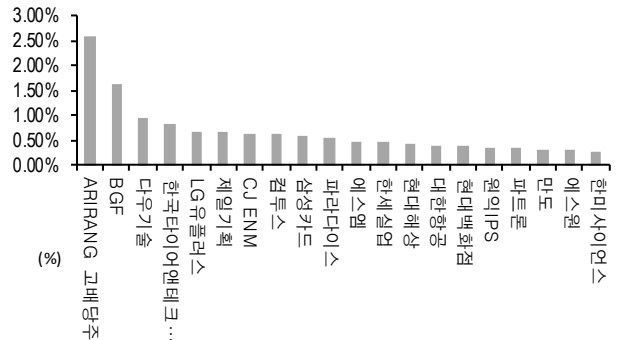
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,732,029	4,479.4	3,922,467	-1,706,064	-69,957	53,965	13,933	-32.4	-22.9	56.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
아모레퍼시픽	171,500	-1.72	16.1	27.4	0	-11,170	0.19%	-156	105	43	-265	295
대한항공	20,500	-1.20	11.3	26.7	0	-68,402	0.40%	3,356	13,369	-16,742	-3,388	-11,252
LG 화학	459,000	4.08	146.3	25.6	0	-23,429	-0.11%	-655	-3,183	3,824	1,564	771
하나투어	40,900	-1.68	1.0	21.9	0	-2,667	0.09%	-64	1,506	-1,442	-1,316	-218
현대차	108,000	-3.14	49.1	21.4	0	-62,270	-0.28%	-1,107	-1,756	2,836	-1,556	5,044
삼성전자	53,800	-2.89	384.3	21.1	0	-839,919	-0.14%	-3,066	-13,683	18,327	46,392	-3,312
SK 하이닉스	88,200	-2.86	101.6	21.1	0	-213,188	-0.06%	-2,883	-14,547	17,919	15,030	6,926
한샘	89,000	-1.66	2.2	18.8	0	-2,935	-0.02%	202	44	-246	-215	-26
하이트진로	38,800	-0.64	5.3	18.6	0	-11,706	-0.18%	-424	-626	1,114	780	188
엔씨소프트	817,000	-0.49	17.3	16.3	0	-2,058	-0.09%	-118	82	36	-212	117

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터