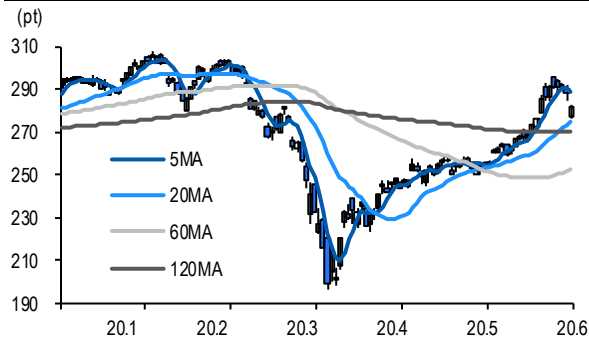


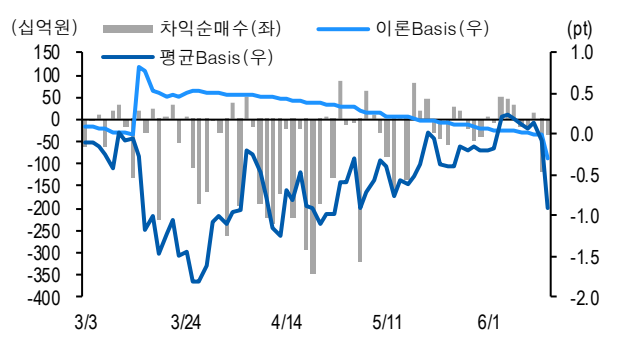


선물옵션시장 지표 2020.6.15

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	281.78	-2.37	-6.84	10,778.9	-
선물 9월물	278.40	-2.76	-7.90	25,739.2	273,757
선물 12월물	279.50	-2.14	-6.10	57.6	37,143
7월물(mini)	278.98	-2.52	-7.20	2,873.4	52,363
8월물(mini)	280.08	-1.54	-4.38	22.9	805

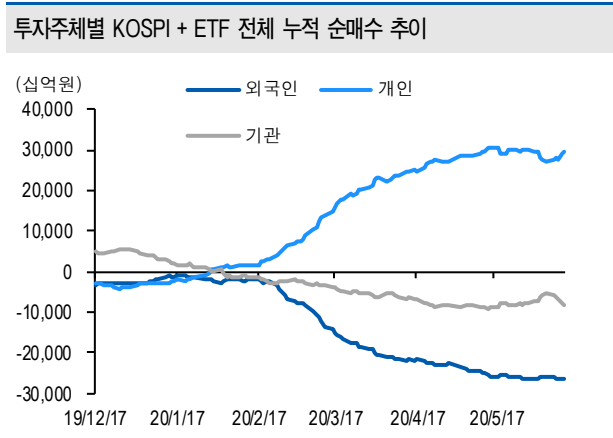


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-0.29	-0.91	-3.38	-0.22%	
베이스(mini)	-0.67	-0.82	-2.80	-0.05%	
제1스프레드(SP)	-0.10	-0.57	-0.70	-0.17%	
합성선물 베이스(ATM)	-0.67	-3.18	-3.18	-0.89%	

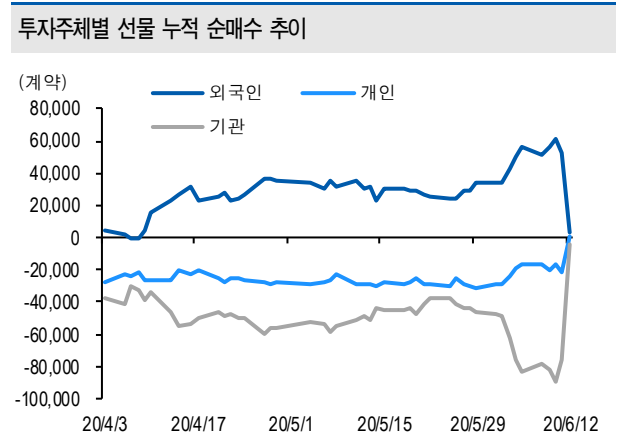


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-117.0	8.8	-108.1	0.0	1.2	324.0	-981.9	-12.3	-6.0	-32.4
개인	1,269.7	23.9	1,293.6	0.0	-0.4	-455.4	23.4	-2.1	6.2	-22.9
기관	-1,182.7	-22.2	-1,204.9	-116.9	-159.9	34.6	958.0	14.3	-0.9	56.0
금융투자	-738.4	-14.5	-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	771,809	307.0	555,062	22.7%	지수옵션 전체	1,977,766	766.0	1,448,757
Put	1,205,957	459.0	893,695	31.2%	PCR(금액기준)	1.49	VKOSPI	32.88%(+6.09%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	295.0(K+3)	2.27	-1.23	70,395	8,082	1,965	22.6	Put	290.0(K+1)	13.70	4.43	836	3,588	-64	27.1
	292.5(K+2)	2.84	-1.57	43,958	5,003	1,017	22.5		287.5(K+0)	13.40	5.40	2,269	2,750	1,278	31.5
	290.0(K+1)	3.61	-1.78	38,497	9,638	2,618	22.8		285.0(K-1)	11.85	4.95	2,014	4,409	15	31.3
	287.5(K+0)	4.50	-2.21	24,002	6,611	2,124	23.1		282.5(K-2)	9.61	3.68	3,602	2,474	452	28.6
	285.0(K-1)	5.52	-2.53	12,197	4,920	623	23.4		280.0(K-3)	9.32	4.23	8,648	4,995	295	31.9

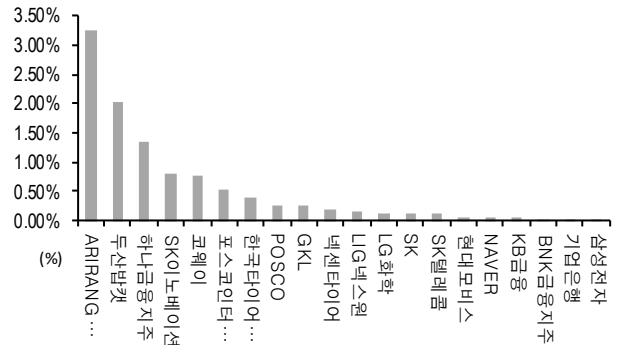
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,934,483	3,201.7	4,053,795	131,328	46,675	6,445	-55,141	20.8	15.9	-37.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	379,500	-1.94	270.8	71.3	21,008	-2,965	-0.02%	339	-72	-239	-1,843	3,428
LG 이노텍	172,500	4.23	39.4	70.3	23,393	1,721	-0.03%	51	-804	766	204	-827
카카오	267,500	1.13	269.5	60.9	45,016	5,381	0.01%	292	3,725	-4,243	563	-5,919
SK 하이닉스	85,100	-3.95	236.3	60.6	180,114	-22,448	-0.02%	-27	-10,208	10,313	19,069	3,142
LG 화학	463,500	-0.11	272.0	60.6	29,451	4,875	0.13%	-355	920	-582	-460	-2,519
대림산업	85,500	-4.58	15.3	58.4	12,226	431	0.00%	865	-447	-482	-4	-745
삼성전자	51,800	-3.90	742.8	53.7	1,316,960	-16,527	0.02%	28,498	3,778	-33,701	22,345	1,016
엔씨소프트	821,000	-0.12	38.5	46.3	2,284	-154	-0.16%	115	-94	-39	-202	214
삼성전기	130,000	-0.76	57.5	44.3	17,775	1,314	-0.40%	984	1,050	-2,054	14	-908
기아차	34,950	-1.41	28.5	42.1	32,925	5,945	-0.15%	-2,496	3,192	-706	5,245	-5,772

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터