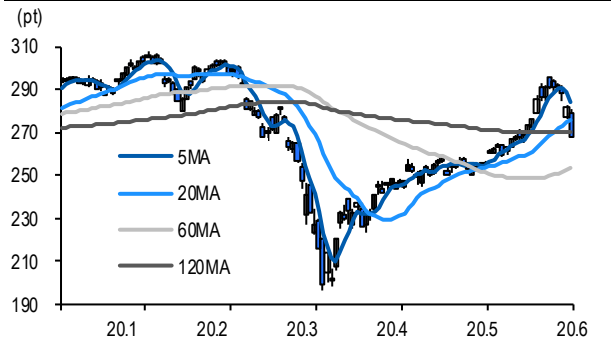


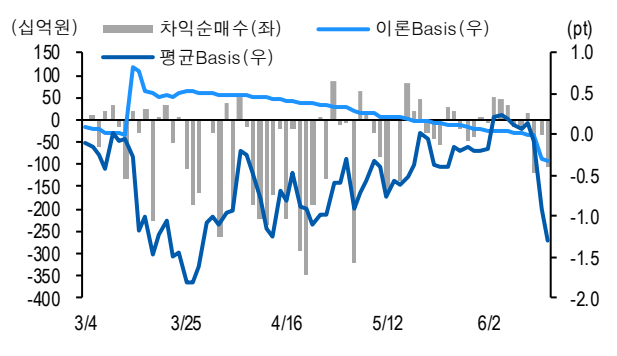


선물옵션시장 지표 2020.6.16

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	267.95	-4.91	-13.83	12,796.2	-
선물 9월물	265.00	-4.81	-13.40	30,432.2	283,472
선물 12월물	264.40	-5.40	-15.10	44.2	37,175
7월물(mini)	265.82	-4.72	-13.16	2,881.3	60,056
8월물(mini)	266.04	-5.01	-14.04	17.6	880

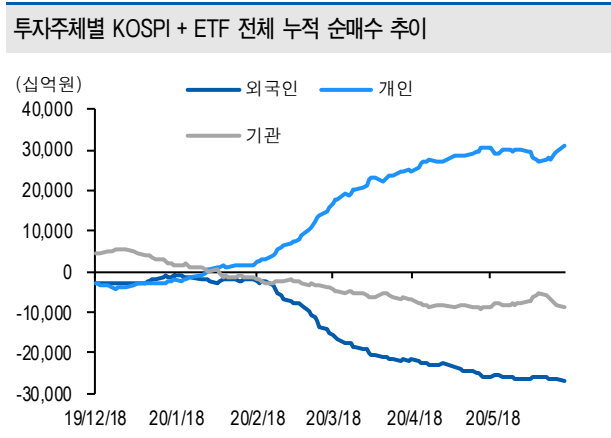


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.33	-1.31	-2.95	-0.37%	
베이스스(mini)	-0.69	-0.92	-2.13	-0.09%	
제1스프레드(SP)	-0.12	-0.65	-0.65	-0.20%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.69	-1.08	-1.08	-0.15%	

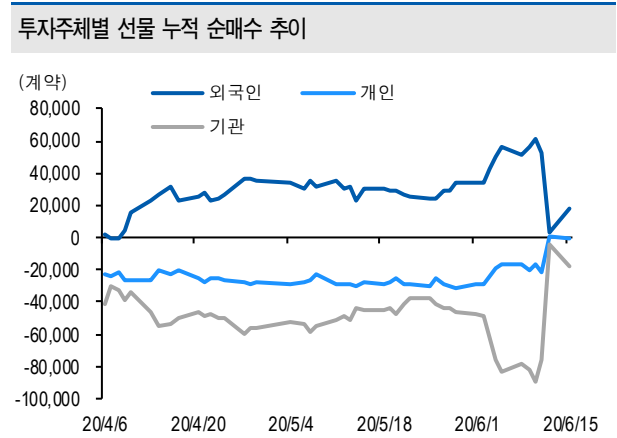


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-473.2	70.8	-402.4	-45.6	-313.2	932.5	59.3	-3.9	5.2	-15.8	
개인	1,240.0	-34.3	1,205.7	0.0	-1.3	-48.9	-3.6	1.9	-2.8	-42.3	
기관	-764.7	-24.6	-789.2	-60.8	-182.5	-804.4	-55.6	2.3	-1.9	59.0	
금융투자	-373.9	38.2	-335.7	-38.1	-23.4	344.0	-55.6	2.7	-1.7	36.4	
투신	-111.3	-80.0	-191.3	-13.2	-56.2	-1,062.7	-0.3	-0.4	-0.3	-16.2	
은행+보험+기타금융	-40.5	12.0	-28.5	-11.3	-5.0	-110.5	0.0	0.0	0.1	2.0	
연기금+국가자자체	-179.0	-2.9	-182.0	4.5	-87.4	24.7	0.3	0.0	0.0	36.7	
기타법인	-2.2	-12.0	-14.1	0.0	-0.1	-79.2	0.0	-0.3	-0.5	-0.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	842,481	362.3	591,558	29.5%	지수옵션 전체	2,089,681	922.8	1,529,403
Put	1,247,200	560.5	937,845	36.2%	PCR(금액기준)	1.55	VKOSPI	39.69%(+6.81%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	1.61	-2.00	74,415	11,321	1,683	29.6	Put	285.0(K+1)	20.65	8.80	580	4,336	-73	31.9
	287.5(K+2)	2.02	-2.48	39,487	6,938	327	29.7		282.5(K+0)	18.65	9.04	894	2,434	-40	31.7
	285.0(K+1)	2.49	-3.03	32,079	5,513	593	29.9		280.0(K-1)	17.95	8.63	4,511	5,654	659	36.3
	282.5(K+0)	3.02	-3.68	20,963	2,978	-36	29.9		277.5(K-2)	16.25	8.03	5,902	4,723	530	36.4
	280.0(K-1)	3.79	-4.05	13,589	5,268	1,179	30.5		275.0(K-3)	14.65	7.42	8,556	4,926	74	36.5

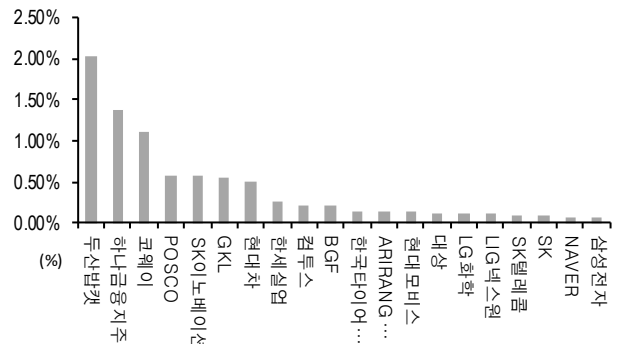
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,837,217	3,952.2	4,136,999	83,204	-7,179	-32,705	40,463	-15.8	-42.3	59.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	159,500	-7.54	41.3	91.8	22,811	-582	0.02%	-461	729	-243	-99	167
SK 하이닉스	82,100	-3.53	341.5	86.2	175,905	-4,209	0.03%	-2,644	-8,296	11,114	8,059	-763
삼성 SDI	346,000	-8.83	363.4	83.6	17,629	-3,379	-0.05%	-11	-351	377	100	2,290
엔씨소프트	805,000	-1.95	85.8	67.7	2,079	-205	-0.17%	-100	30	71	-61	222
LG 화학	425,500	-8.20	252.9	67.0	28,937	-514	0.11%	-227	-541	772	-462	1,249
카카오	251,500	-5.98	264.8	65.3	40,669	-4,347	-0.01%	632	-2,729	2,106	-1,419	3,113
삼성전자	49,650	-4.15	807.4	55.8	1,306,586	-10,374	0.07%	9,226	-40,223	31,025	49,961	-8,229
POSCO	175,500	-5.14	45.6	54.0	30,368	2,394	0.58%	585	-524	-3	1,299	-1,615
KB 금융	33,200	-4.32	62.4	53.7	107,911	1,116	-0.04%	-379	-1,713	2,042	1,055	-352
한국금융지주	48,200	-7.49	12.4	53.5	18,840	-9,121	-0.12%	2,290	-237	-2,043	880	482

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터