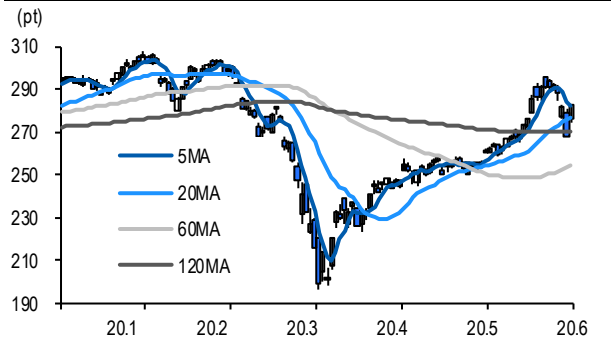


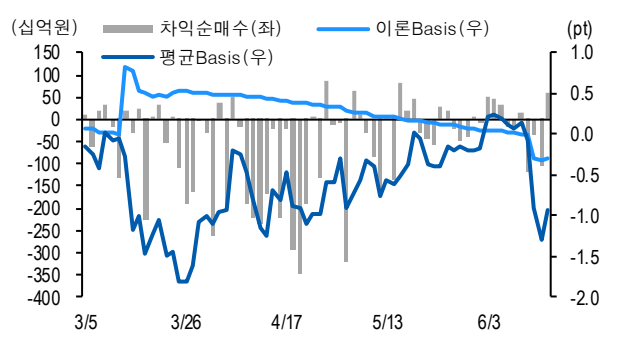


선물옵션시장 지표 2020.6.17

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	282.59	5.46	14.64	9,547.7	-
선물 9월물	279.80	5.58	14.80	29,280.3	283,269
선물 12월물	281.10	6.32	16.70	26.7	37,215
7월물(mini)	280.04	5.35	14.22	2,833.5	62,517
8월물(mini)	281.36	5.76	15.32	14.5	1,008

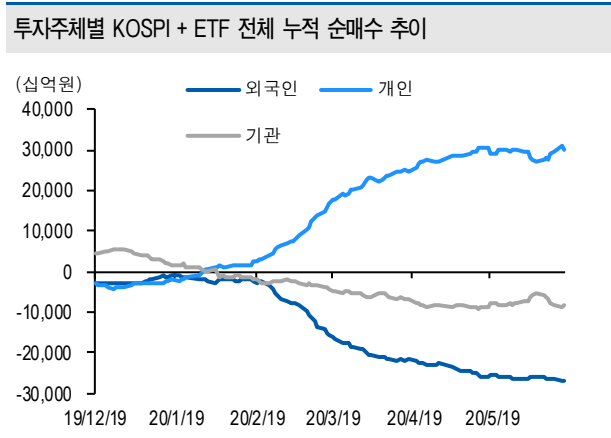


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-0.31	-0.92	-2.79	-0.22%	
베이스(mini)	-0.69	-0.62	-2.55	0.02%	
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.69	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스(ATM)	-0.69	-1.61	-1.61	-0.33%	

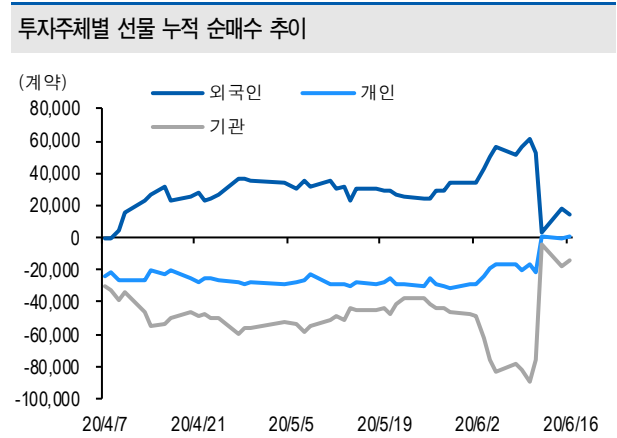


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	100.6	18.1	118.7	-0.5	186.4	-727.2	452.0	-0.4	-0.3	5.1	
개인	-585.9	25.4	-560.5	0.0	0.1	71.2	-22.6	2.3	-0.5	17.4	
기관	474.0	-39.1	434.8	61.7	-62.6	661.1	-429.3	-1.7	1.2	-23.9	
금융투자	415.7	52.2	467.9	-34.5	7.9	-364.2	-429.3	-1.2	1.2	-12.3	
투신	1.4	-95.5	-94.1	0.0	-16.0	1,098.5	0.2	-0.4	0.0	12.7	
은행+보험+기타금융	-12.9	-21.3	-34.2	0.0	-13.9	24.2	0.0	-0.1	-0.1	0.1	
연기금+국가자재	78.3	-0.7	77.6	96.1	-25.2	-97.5	-0.2	0.0	0.0	-24.4	
기타법인	11.4	-4.4	6.9	0.0	0.1	-5.1	-0.1	-0.2	-0.4	1.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,159,190	507.4	620,348	29.0%	지수옵션 전체	2,107,952	905.1	1,596,850
Put	948,762	397.7	976,502	38.8%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	35.90%(-3.79%p)

	Call				Put									
	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	275.0(K+3)	12.20	6.71	4,511	3,145	445	29.1	270.0(K+1)	5.61	-6.34	15,759	11,258	366	37.3
	272.5(K+2)	13.75	7.32	760	2,081	57	29.0	267.5(K+0)	5.02	-5.68	13,836	5,037	899	38.2
	270.0(K+1)	15.55	8.04	1,157	3,918	721	29.3	265.0(K-1)	4.41	-5.19	22,713	7,930	-790	38.7
	267.5(K+0)	18.50	13.36	287	377	3	34.3	262.5(K-2)	3.96	-4.54	18,165	4,822	396	39.8
	265.0(K-1)	20.80	9.90	134	2,004	58	36.5	260.0(K-3)	3.50	-4.07	27,481	10,133	160	40.5

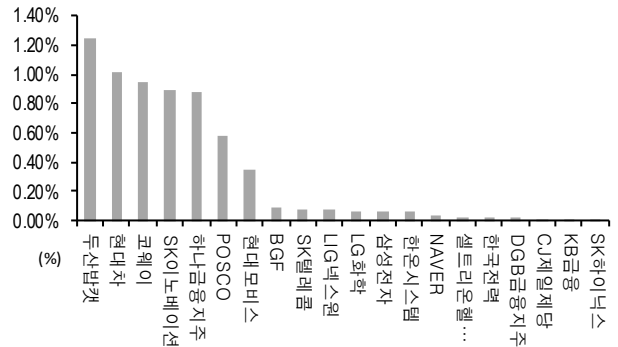
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,493,521	3,240.8	4,329,970	192,971	94,498	12,848	-108,159	5.1	17.4	-23.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	167,500	5.02	40.8	113.6	17,861	-4,950	-0.26%	442	494	-923	-787	1,574
삼성 SDI	375,500	8.53	249.6	81.8	15,352	-2,277	-0.08%	421	552	-989	1,176	629
SK 하이닉스	85,000	3.53	228.1	77.4	180,698	4,793	0.00%	3,975	-2	-4,040	-5,354	-641
삼성전자	51,300	3.32	749.5	67.3	1,307,751	1,165	0.07%	13,381	-6,101	-7,558	-18,185	-4,969
LG 화학	486,500	14.34	347.1	65.5	32,789	3,852	0.07%	-1,478	38	1,440	140	-1,320
엔씨소프트	871,000	8.20	68.5	59.6	2,030	-49	-0.15%	0	-210	210	13	262
대림산업	84,100	5.13	9.3	58.4	12,955	883	-0.02%	439	298	-719	96	-915
카카오	261,500	3.98	134.9	57.1	40,436	-233	-0.07%	288	1,292	-1,597	-1,674	155
삼성전기	130,500	5.67	55.3	55.7	19,290	4,150	-0.20%	1,780	1,273	-3,052	-1,829	-3,385
현대건설	32,900	4.94	13.1	53.8	15,719	2,980	-0.15%	4,159	341	-4,500	-1,322	-3,212

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터