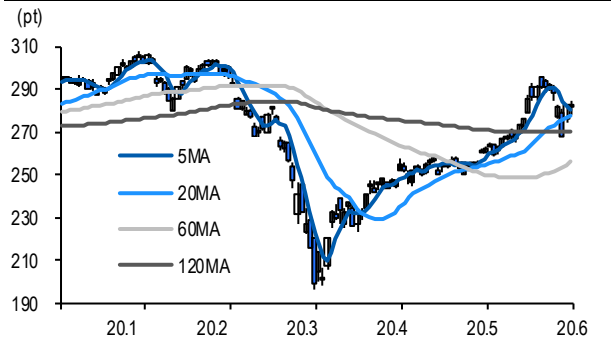


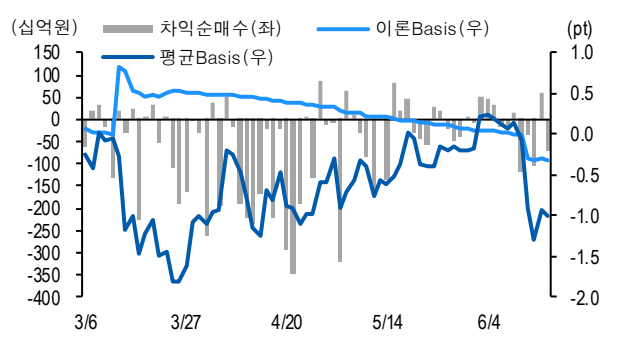


선물옵션시장 지표 2020.6.18

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	283.02	0.15	0.43	11,351.0	-
선물 9월물	281.85	0.73	2.05	33,659.5	276,912
선물 12월물	281.35	0.09	0.25	35.1	37,397
7월물(mini)	282.20	0.77	2.16	2,484.5	55,749
8월물(mini)	281.92	0.20	0.56	21.4	1,038

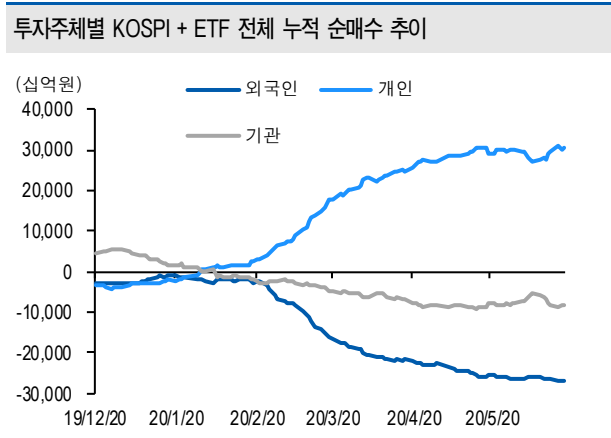


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.31	-1.00	-1.17	-0.24%	
베이스스(mini)	-0.69	-0.71	-0.82	-0.01%	
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.61	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.69	-0.87	-0.87	-0.06%	

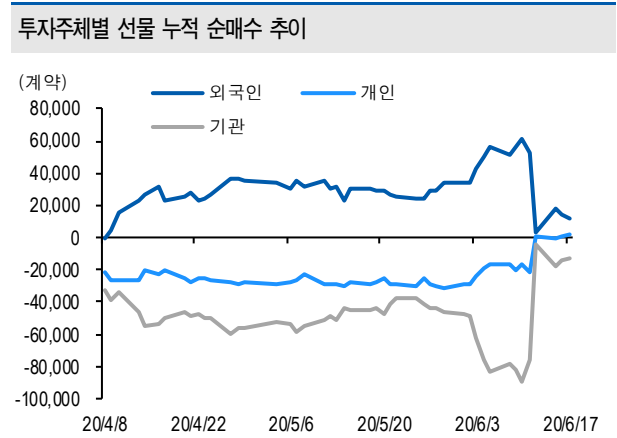


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-51.9	31.1	-20.8	0.0	-1.3	44.1	-163.6	6.5	-1.3	-24.0
개인	152.5	-63.3	89.2	0.0	-0.2	75.0	11.0	-0.5	-0.8	29.1
기관	-115.1	30.1	-85.0	-70.5	-19.3	-97.9	152.4	-5.4	2.6	-6.0
금융투자	-178.2	118.5	-59.7	-15.0	-7.9	-21.4	151.1	-4.8	2.6	16.0
투신	-22.0	-18.5	-40.5	-9.2	-18.4	-82.5	1.2	-0.4	0.0	25.9
은행+보험+기타금융	-16.1	-30.0	-46.1	0.0	-2.9	-35.9	0.0	-0.1	0.0	2.9
연기금+국가자재	90.7	-39.6	51.2	-46.3	11.5	41.9	0.1	0.0	0.0	-50.9
기타법인	14.5	2.1	16.6	0.0	0.0	-21.3	0.2	-0.6	-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	1,073,778	530.5	632,885	30.8%	지수옵션 전체	2,239,161	1,077.1	1,640,626
Put	1,165,383	546.5	1,007,741	34.7%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	37.05%(+1.15%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	5.44	0.93	31,961	13,524	175	30.5	Put	285.0(K+1)	10.45	-0.20	1,258	4,455	73	31.9
	287.5(K+2)	6.52	1.06	28,021	7,725	142	31.1		282.5(K+0)	9.44	-0.91	2,556	2,558	645	33.1
	285.0(K+1)	7.73	1.18	15,706	6,209	331	31.7		280.0(K-1)	8.40	-0.74	8,963	6,172	267	33.8
	282.5(K+0)	9.09	1.32	9,092	3,176	-238	32.5		277.5(K-2)	7.47	-0.61	10,680	3,519	-330	34.6
	280.0(K-1)	10.45	1.33	5,005	5,959	452	32.8		275.0(K-3)	6.63	-0.57	9,258	5,476	560	35.4

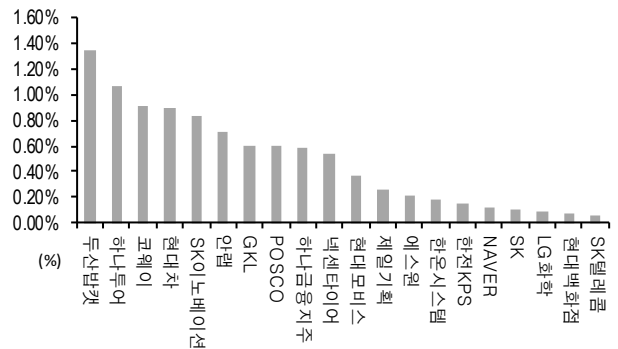
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,729,927	4,116.5	4,505,653	175,683	-74,936	31,456	43,097	-24.0	29.1	-6.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	86,500	1.76	365.4	102.8	217,301	36,603	0.01%	215	-2,585	2,301	2,389	-19,346
삼성 SDI	384,500	2.40	395.2	99.7	17,308	1,956	-0.05%	-1,591	2,643	-717	786	-1,449
LG 이노텍	168,500	0.60	38.1	92.1	15,725	-2,136	-0.11%	118	-288	157	818	515
카카오	263,500	0.76	251.5	82.6	36,840	-3,596	-0.10%	-1,129	-574	1,707	-1,196	4,269
LG 화학	492,000	1.13	476.6	73.4	33,741	952	0.09%	-1,841	434	1,391	1,272	358
대림산업	85,200	1.31	12.9	72.7	11,247	-1,708	-0.05%	619	-2,084	1,462	53	1,739
KB 금융	35,000	-1.96	93.0	70.4	114,454	4,238	0.01%	6,309	-348	-6,051	-9,135	2,397
ARIRANG 고배당주	8,875	1.72	0.2	67.1	9	0	-0.44%	0	0	0	0	0
삼성전자	51,900	1.17	922.9	66.5	1,345,571	37,820	0.06%	-9,027	22,726	-13,707	-11,797	-9,807
기아차	33,300	-2.92	37.9	66.0	27,855	-216	-0.18%	1,562	348	-2,011	-1,167	880

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

