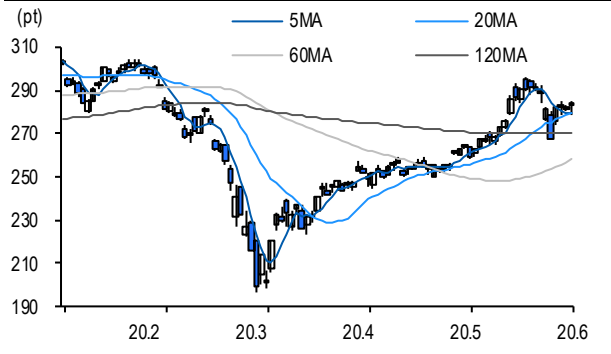


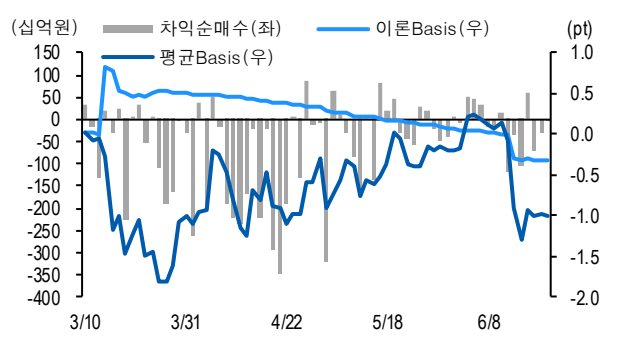


선물옵션시장 지표 2020.6.22

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	283.37	0.52	1.46	7,353.6	-
선물 9월물	282.20	0.20	0.55	24,046.1	276,283
선물 12월물	281.55	0.20	0.55	39.3	37,431
7월물(mini)	282.56	0.21	0.58	2,560.8	53,957
8월물(mini)	282.14	0.24	0.68	12.9	1,313

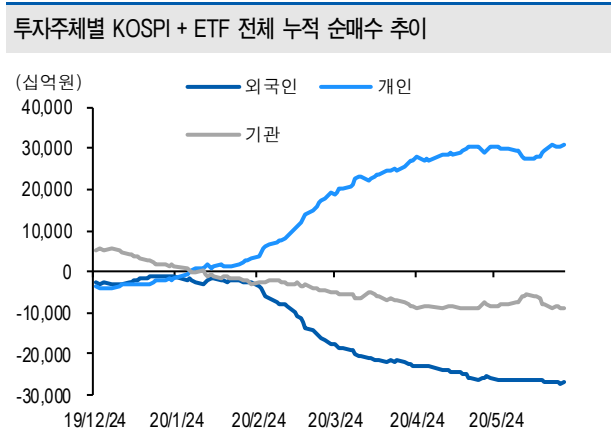


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-0.32	-1.01	-1.17	-0.24%	
베이스스(mini)	-0.71	-0.68	-0.81	0.01%	
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.70	-0.70	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.71	-0.91	-0.91	-0.07%	

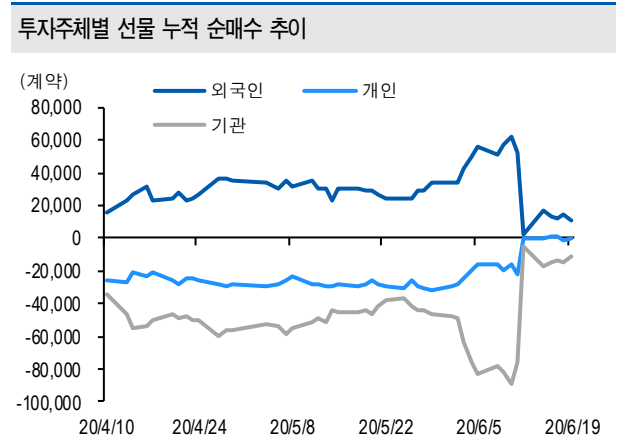


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	55.6	-9.1	46.6	0.0	-187.1	-272.7	-24.8	-6.0	-3.1	13.5	
개인	166.2	-134.8	31.4	0.0	-1.2	128.8	2.1	4.2	-0.1	1.7	
기관	-222.2	146.4	-75.8	-1.3	-93.4	169.6	22.1	2.2	3.8	-13.9	
금융투자	-80.0	148.7	68.7	-5.6	-10.7	113.8	22.1	2.1	3.9	-34.4	
투신	-41.1	2.2	-38.9	0.0	-24.9	47.9	0.0	0.2	0.0	0.4	
은행+보험+기타금융	-24.6	-11.3	-36.0	0.0	-17.1	11.4	0.0	-0.1	-0.1	0.3	
연기금+국가자재	-42.8	-1.4	-44.1	4.3	-17.4	-3.5	0.0	0.0	0.0	19.8	
기타법인	0.4	-2.5	-2.1	0.0	0.0	-25.7	0.6	-0.4	-0.6	-1.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





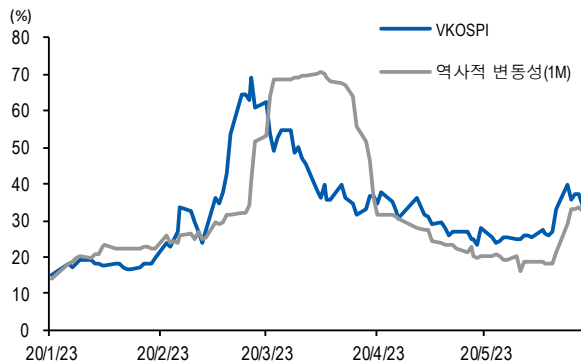
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	821,832	362.8	676,082	28.4%	지수옵션 전체	1,828,203	771.8	1,718,057			
Put	1,006,371	408.9	1,041,975	32.0%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	34.04%(-3.26%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	4.57	-0.65	34,750	12,123	-956	28.1	Put	285.0(K+1)	9.25	-1.25	916	4,574	122	29.6
	287.5(K+2)	5.61	-0.70	16,554	8,620	985	28.6		282.5(K+0)	8.14	-1.34	2,071	3,480	560	30.4
	285.0(K+1)	6.79	-0.72	18,270	7,314	1,073	29.1		280.0(K-1)	7.10	-1.21	9,335	7,887	1,312	31.1
	282.5(K+0)	8.10	-0.72	10,560	3,649	646	29.7		277.5(K-2)	6.19	-1.17	4,996	3,710	152	31.8
	280.0(K-1)	9.58	-0.72	8,268	6,998	1,155	30.4		275.0(K-3)	5.39	-1.18	7,478	5,606	-308	32.6

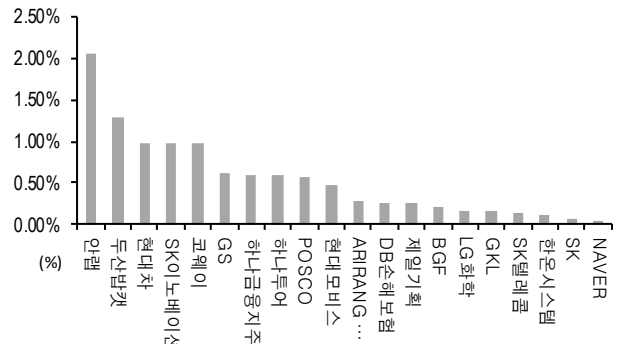
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,492,477	2,531.5	4,575,621	-20,114	10,526	25,955	-36,657	13.5	1.7	-13.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	263,000	-0.19	204.4	84.7	35,816	-3,532	-0.02%	-1,482	-5,673	7,162	1,900	4,307
LG 이노텍	165,500	-1.19	22.7	80.1	14,294	-1,101	-0.20%	800	461	-1,261	-643	-419
삼성전기	131,000	1.55	38.0	79.1	20,687	1,689	-0.33%	1,898	1,087	-3,005	-1,820	-1,026
SK 하이닉스	85,200	-1.50	208.3	76.2	184,957	-28,195	-0.02%	235	3,526	-3,691	-4,509	16,960
삼성 SDI	384,500	1.85	148.3	65.9	15,339	511	-0.12%	643	572	-1,219	-18	-871
삼성전자	52,400	0.58	596.4	65.1	1,323,625	-21,544	-0.03%	13,200	2,139	-15,342	-2,223	-18,976
기아차	32,900	-1.50	31.0	63.6	32,811	-3,631	-0.11%	-2,109	-2,794	4,903	2,195	1,635
LG 화학	513,000	4.06	193.6	52.6	36,086	1,323	0.17%	354	370	-713	-2,003	-82
LG 전자	68,400	0.74	29.5	51.2	25,856	-641	-0.24%	-2,423	234	2,577	225	2,560
KB 금융	36,050	2.12	63.7	50.2	118,376	-2,258	0.04%	-7,187	-1,999	9,229	4,185	4,426

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터