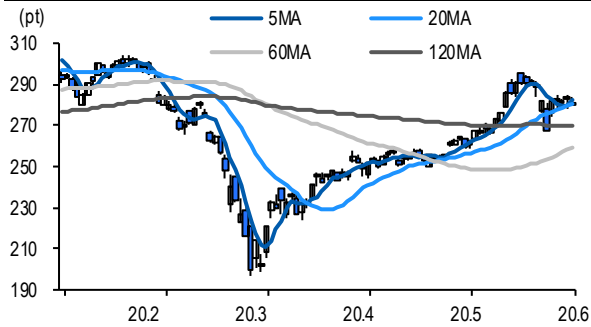


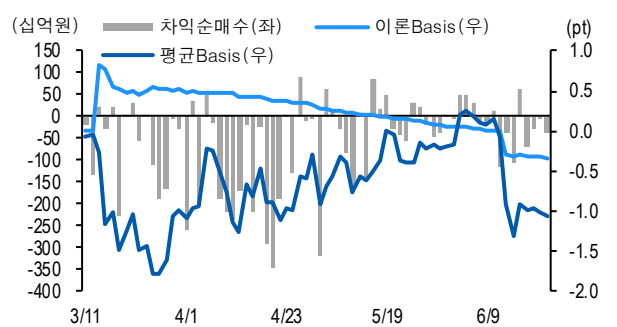


선물옵션시장 지표 2020.6.23

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	281.42	-0.69	-1.95	6,384.3	-
선물 9월물	279.90	-0.82	-2.30	16,914.9	277,802
선물 12월물	279.45	-0.75	-2.10	20.0	37,444
7월물(mini)	280.28	-0.81	-2.28	1,772.0	56,818
8월물(mini)	280.04	-0.74	-2.10	4.9	1,350

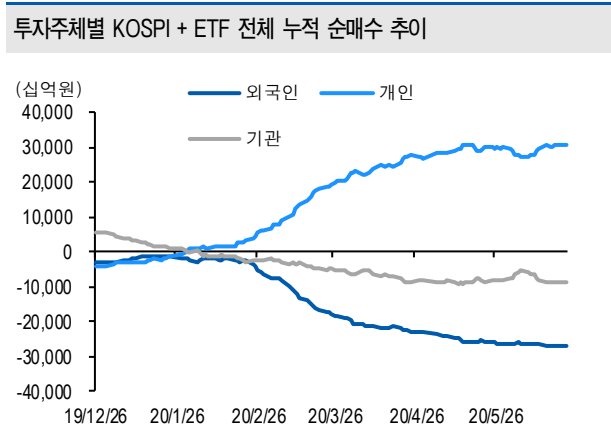


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-0.35	-1.06	-1.52	-0.25%
베이스스(mini)	-0.73	-0.74	-1.14	-0.01%
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.70	-0.70	-0.22%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.73	-1.14	-1.14	-0.15%

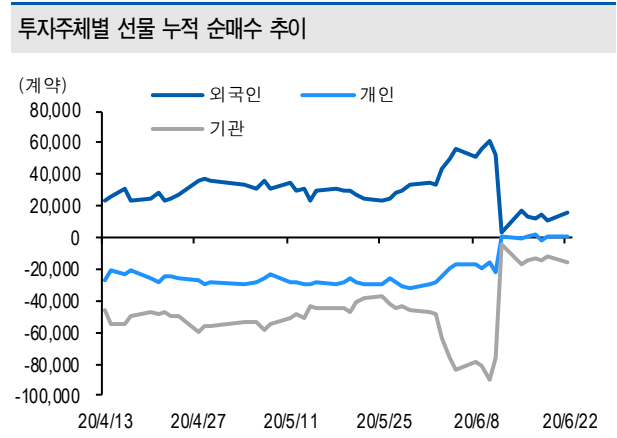


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-251.0	-3.4	-254.4	-4.4	-176.6	402.9	-63.7	-1.0	-1.8	-3.7
개인	431.0	-47.7	383.3	0.0	-1.3	-25.4	0.2	-0.9	-0.2	26.3
기관	-196.4	50.3	-146.1	-32.1	-39.2	-379.3	63.6	1.8	2.2	-23.4
금융투자	-25.6	72.9	47.3	-11.3	9.5	-322.8	63.9	1.8	1.6	-29.6
투신	-25.8	-7.9	-33.7	0.0	-9.7	-93.2	-0.3	0.0	-0.1	-21.3
은행+보험+기타금융	-45.1	0.7	-44.4	0.0	-26.5	16.5	0.0	0.0	0.6	4.3
연기금+국가자자체	-61.7	-8.5	-70.2	-20.8	2.9	20.2	0.0	0.0	0.0	23.2
기타법인	16.4	0.9	17.2	0.0	0.0	1.8	-0.1	0.1	-0.2	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





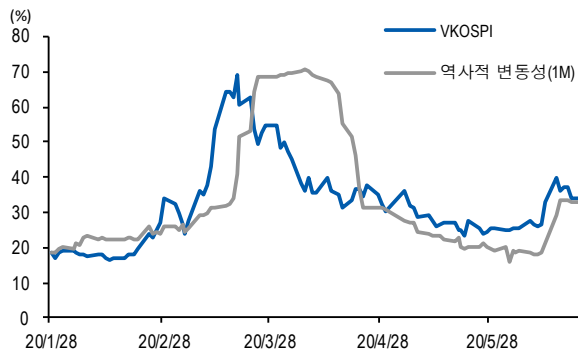
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	605,166	230.4	688,210	27.9%	지수옵션 전체	1,249,995	459.3	1,754,518
Put	644,829	228.9	1,066,308	32.5%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	34.03%(-0.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	3.32	-1.25	26,861	12,822	699	27.7	Put	285.0(K+1)	9.83	0.58	1,094	4,877	303	29.9
	287.5(K+2)	4.20	-1.41	18,034	8,645	25	28.2		282.5(K+0)	8.65	0.51	2,549	3,617	137	30.9
	285.0(K+1)	5.24	-1.55	12,398	7,232	-82	28.7		280.0(K-1)	7.48	0.38	7,597	8,197	310	31.5
	282.5(K+0)	6.43	-1.67	3,055	3,822	173	29.3		277.5(K-2)	6.47	0.28	2,795	3,683	-27	32.2
	280.0(K-1)	7.74	-1.84	3,017	7,141	143	29.8		275.0(K-3)	5.61	0.22	9,492	5,068	-538	33.1

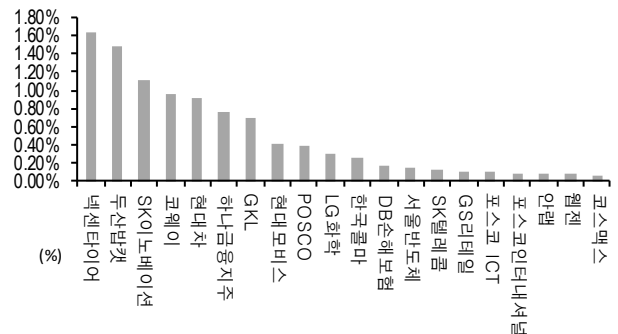
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,880,313	2,335.2	4,626,817	51,196	14,718	30,111	-45,877	-3.7	26.3	-23.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	85,100	-0.12	165.7	91.4	171,139	-13,818	-0.03%	1,835	1,804	-3,721	4,120	9,673
LG 이노텍	161,000	-2.72	24.7	79.4	11,877	-2,417	-0.35%	562	-69	-497	988	1,484
ARIRANG 고배당주	8,705	-0.85	0.5	78.8	9	0	-0.40%	0	0	0	0	0
삼성전자	51,800	-1.15	511.1	72.2	1,332,026	8,401	-0.03%	29,450	18,845	-48,270	-35,131	-9,780
삼성 SDI	380,500	-1.04	115.3	70.0	14,911	-428	-0.15%	-51	-475	538	474	1,069
삼성전기	130,000	-0.76	29.1	67.0	18,188	-2,499	-0.30%	47	-423	388	1,022	1,058
대림산업	86,600	-1.70	11.6	62.5	10,202	-608	-0.11%	-1,278	521	762	159	606
카카오	273,000	3.80	329.4	60.4	37,698	1,882	-0.09%	489	876	-1,389	-119	-2,186
KB 금융	34,750	-3.61	30.6	51.6	120,449	2,073	0.03%	-4,015	3,393	432	-1,324	862
NAVER	270,500	8.85	222.2	51.4	50,247	5,997	0.02%	-91	3,440	-3,298	13	-3,703

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

