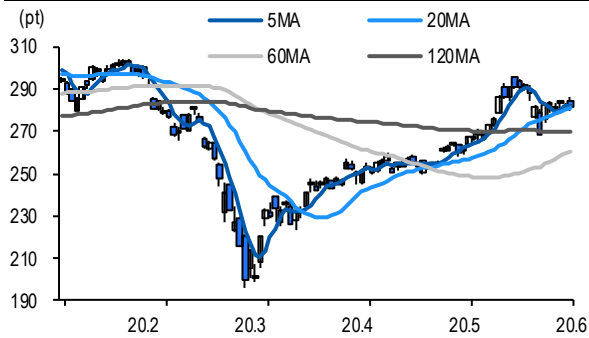
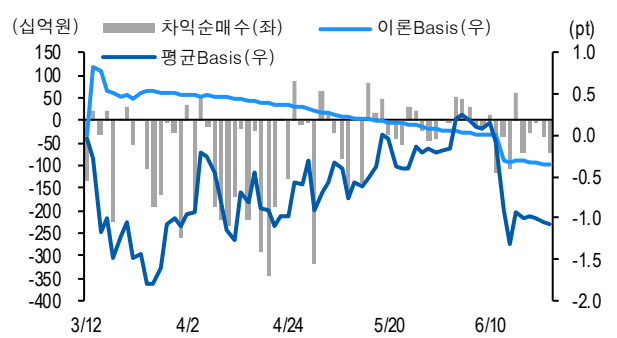


선물옵션시장 지표 2020.6.24

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	281.94	0.18	0.52	8,855.4	-	
선물 9월물	281.50	0.57	1.60	33,576.6	277,428	
선물 12월물	280.00	0.20	0.55	43.1	37,465	
7월물(mini)	281.76	0.53	1.48	2,605.5	61,788	
8월물(mini)	281.38	0.48	1.34	10.8	1,457	

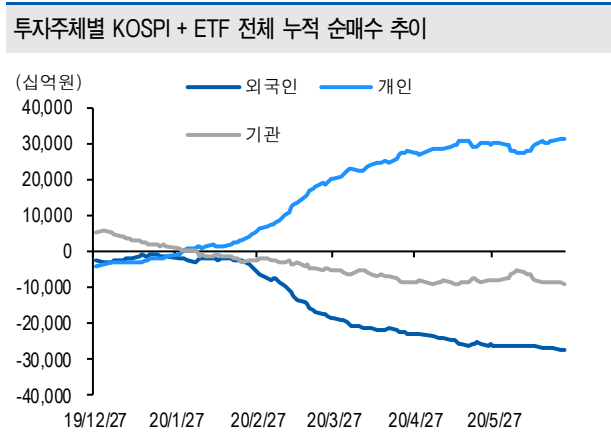


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.35	-1.07	-0.44	-0.26%	
베이스스(mini)	-0.73	-0.72	-0.18	0.00%	
제1스프레드(SP)	-0.10	-0.70	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.73	-0.16	-0.16	0.20%	

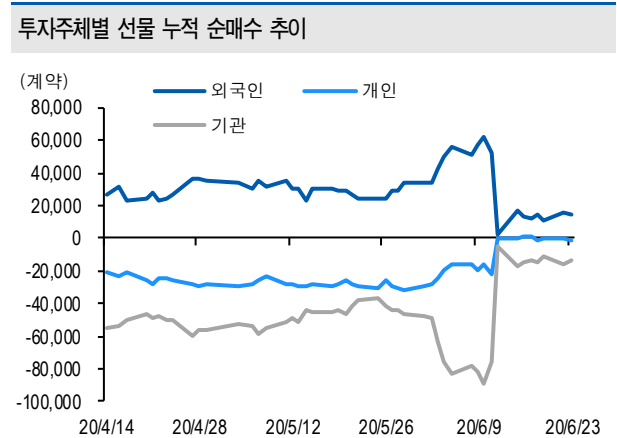


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-52.8	24.2	-28.6	-6.2	15.7	1.3	-54.5	-0.3	-2.6	-37.6	
개인	350.4	-97.5	252.9	0.0	0.1	-129.6	-3.2	-0.5	0.2	-1.7	
기관	-281.4	73.1	-208.3	-65.2	-95.0	133.9	57.2	1.2	2.6	40.3	
금융투자	-142.7	206.4	63.6	-58.0	-4.5	225.2	57.4	1.4	2.7	34.7	
투신	-66.3	-125.7	-192.0	0.0	-47.3	-47.6	-0.2	-0.1	0.0	-1.1	
은행+보험+기타금융	-18.9	-12.5	-31.5	-0.4	-15.0	-47.2	0.0	0.0	0.0	1.1	
연기금+국가자자체	-36.8	-12.6	-49.4	-6.8	4.2	3.5	-0.1	0.0	0.0	5.6	
기타법인	-16.1	0.2	-15.9	0.0	-0.1	-5.6	0.6	-0.4	-0.2	-1.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





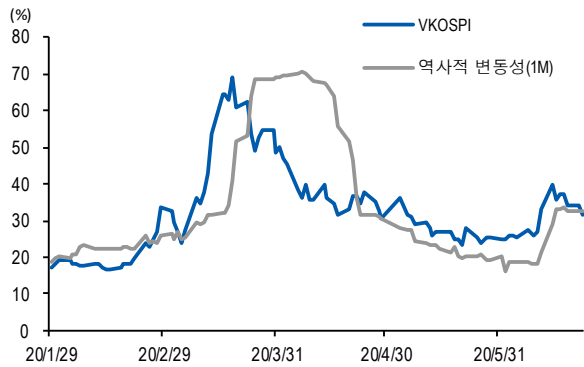
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	968,381	384.6	707,509	26.9%	지수옵션 전체	2,189,005	848.5	1,810,080
Put	1,220,624	463.9	1,102,571	29.0%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	31.73%(-2.30%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	3.04	-0.28	60,307	13,164	342	26.5	Put	285.0(K+1)	8.34	-1.49	3,811	5,174	297	25.7
	287.5(K+2)	3.99	-0.21	32,440	8,257	-388	27.2		282.5(K+0)	7.12	-1.53	8,375	4,315	698	26.6
	285.0(K+1)	5.12	-0.12	21,423	7,979	747	28.1		280.0(K-1)	6.05	-1.43	10,310	8,474	277	27.5
	282.5(K+0)	6.40	-0.03	13,156	4,323	501	29.0		277.5(K-2)	5.16	-1.31	9,528	4,652	969	28.5
	280.0(K-1)	7.86	0.12	8,250	7,577	436	30.0		275.0(K-3)	4.40	-1.21	19,181	5,969	901	29.6

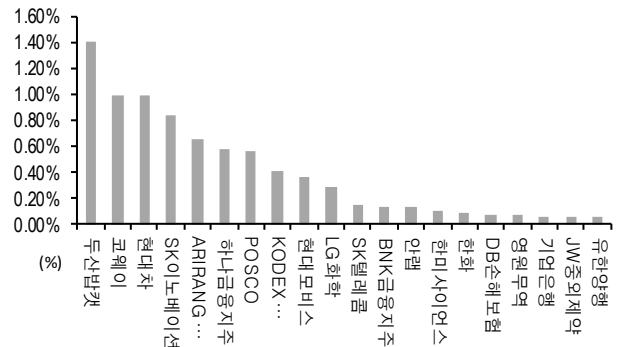
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,600,223	4,247.7	4,692,963	66,146	2,076	16,905	-19,013	-37.6	-1.7	40.3		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	84,000	-1.29	257.4	102.6	161,580	-9,559	0.03%	-3,429	-769	4,103	1,921	2,022
엔씨소프트	918,000	3.38	126.4	94.7	2,217	-71	-0.19%	-331	-406	704	306	390
삼성 SDI	382,000	0.39	198.2	94.7	14,150	-761	-0.08%	-682	-445	1,233	1,526	-609
카카오	280,500	2.75	572.6	93.2	35,530	-2,168	-0.18%	-679	536	195	-1,457	2,633
KB 금융	34,850	0.29	58.9	91.3	121,497	1,048	0.03%	3,845	-131	-3,728	-4,367	812
삼성전자	51,200	-1.16	791.2	84.4	1,354,782	22,756	0.02%	9,217	3,559	-12,669	7,943	-18,245
기아차	32,150	-0.46	39.7	78.3	35,919	4,145	-0.12%	1,452	301	-1,753	-457	-2,037
삼성전기	131,500	1.15	60.9	73.4	17,011	-1,177	-0.26%	-1,446	-307	1,757	871	188
NAVER	276,500	2.22	419.7	71.3	48,496	-1,751	0.02%	-839	250	575	-358	1,839
LG 전자	66,700	-0.74	38.3	67.6	22,675	-1,972	-0.23%	1,461	-2,091	591	-1,372	1,375

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터