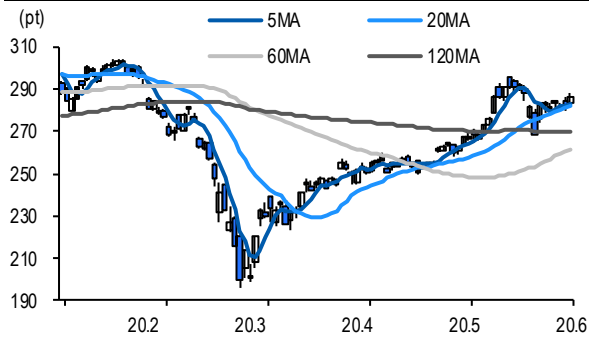


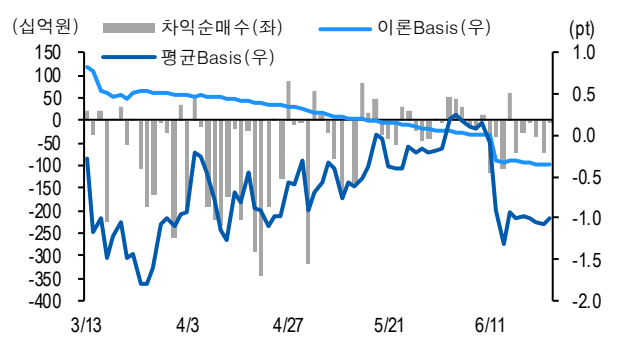


선물옵션시장 지표 2020.6.25

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	286.70	1.69	4.76	8,485.7	-
선물 9월물	286.00	1.60	4.50	21,921.3	285,575
선물 12월물	284.95	1.77	4.95	44.1	37,494
7월물(mini)	286.24	1.59	4.48	1,762.1	69,598
8월물(mini)	285.76	1.56	4.38	10.8	1,516

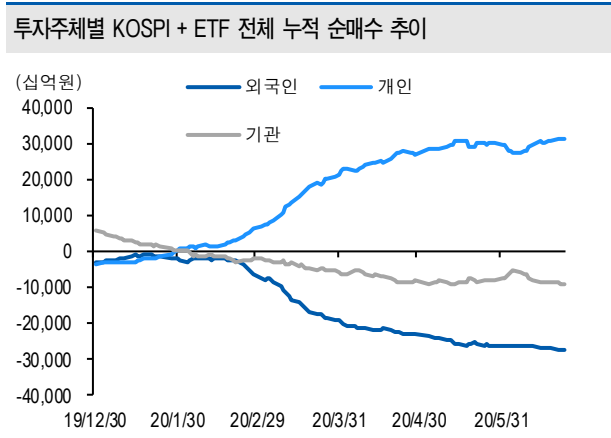


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	-0.35	-1.00	-0.70	-0.23%
베이스스(mini)	-0.74	-0.73	-0.46	0.00%
제1스프레드(SP)	-0.09	-0.75	-0.75	-0.23%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.74	-0.43	-0.43	0.11%

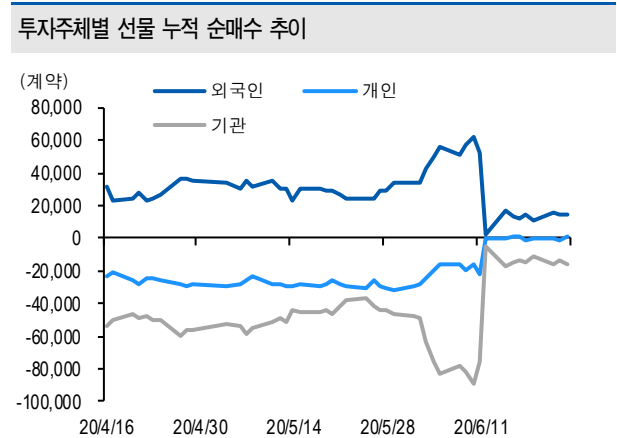


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-156.0	-28.7	-184.7	0.0	-183.3	27.7	16.7	13.3	-3.7	-2.1
개인	-7.2	32.9	25.7	0.0	0.5	192.6	-6.8	-8.5	1.1	35.1
기관	115.6	-3.2	112.4	-3.7	-73.1	-173.0	-9.4	-4.7	2.9	-34.6
금융투자	26.4	41.9	68.3	-20.0	-14.1	-395.7	-9.7	-4.5	3.0	-40.3
투신	0.7	-28.6	-27.9	0.0	-31.9	263.9	0.2	-0.1	0.0	64.4
은행+보험+기타금융	7.4	-9.9	-2.5	0.0	-1.1	-20.8	0.0	0.0	0.0	-1.1
연기금+국가자재	66.2	-3.3	62.9	16.3	-10.0	-20.3	0.1	0.0	0.0	-57.7
기타법인	47.6	-1.1	46.5	0.0	-1.0	-47.3	-0.5	-0.1	-0.3	1.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





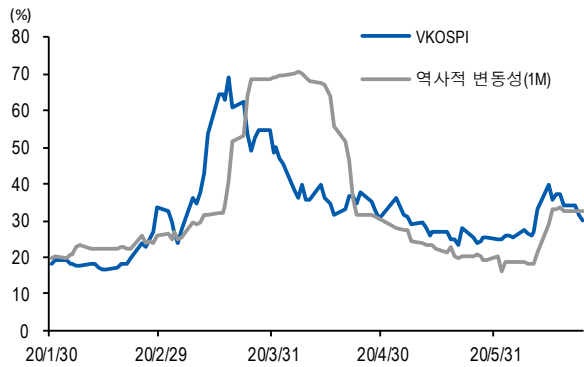
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	947,305	399.9	708,620	26.3%	지수옵션 전체	1,593,960	612.3	1,840,472
Put	646,655	212.3	1,131,852	29.4%	PCR(금액기준)	0.53	VKOSPI	30.20%(-1.53%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	4.50	1.46	42,154	12,114	-1,050	26.3	Put	285.0(K+1)	5.83	-2.51	7,532	5,791	617	26.4
	287.5(K+2)	5.70	1.71	19,239	8,398	141	26.9		282.5(K+0)	4.90	-2.22	8,416	5,488	1,173	27.3
	285.0(K+1)	7.11	1.99	11,882	7,737	-242	27.8		280.0(K-1)	4.12	-1.93	15,648	9,043	569	28.3
	282.5(K+0)	8.67	2.27	6,893	4,587	264	28.6		277.5(K-2)	3.47	-1.69	19,664	5,813	1,161	29.3
	280.0(K-1)	10.40	2.54	1,877	7,441	-136	29.7		275.0(K-3)	2.90	-1.50	25,672	7,754	1,785	30.2

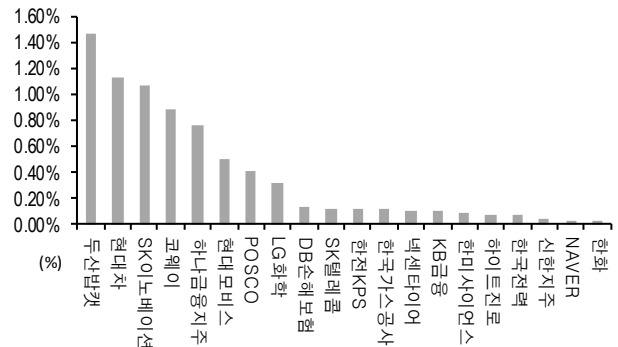
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,883,950	3,031.0	4,865,976	173,013	26,055	44,811	-72,334	-2.1	35.1	-34.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대림산업	86,100	1.65	9.5	78.1	11,335	695	-0.08%	116	353	-452	145	-600
SK 하이닉스	86,200	2.62	261.2	74.5	176,737	15,157	0.02%	3,018	3,067	-6,156	-4,558	-8,592
삼성전자	52,700	2.93	923.8	71.2	1,420,750	65,968	-0.01%	3,294	17,335	-20,661	-35,039	-33,373
삼성 SDI	379,000	-0.79	115.6	70.3	14,199	49	-0.12%	332	592	-932	-140	-60
카카오	282,000	0.53	201.6	66.9	33,835	-1,695	-0.32%	-292	26	283	339	1,399
KB 금융	35,000	0.43	30.8	64.2	133,738	12,241	0.10%	4,038	554	-4,600	4,083	-13,012
삼성전기	136,500	3.80	98.2	62.1	26,641	9,630	-0.19%	-1,681	3,713	-2,042	-3,093	-4,426
LG 이노텍	168,000	3.07	21.9	61.2	13,309	2,317	-0.04%	377	124	-511	844	-1,911
NAVER	279,000	0.90	160.4	58.7	48,757	261	0.04%	343	876	-1,186	-990	569
기아차	33,850	5.29	43.1	54.9	35,409	-510	-0.13%	-3,123	834	2,239	-720	178

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터