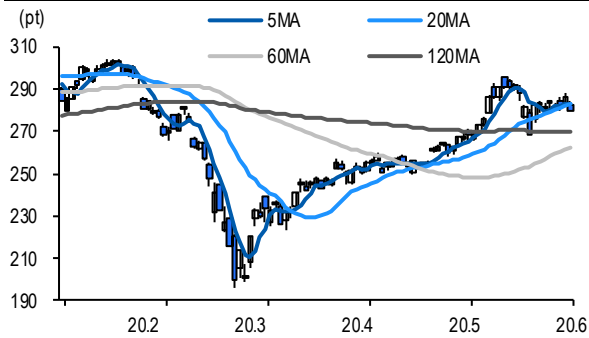


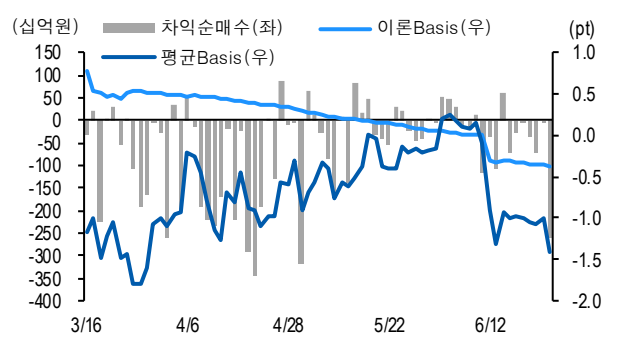


선물옵션시장 지표 2020.6.26

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	279.73	-2.43	-6.97	6,808.8	-
선물 9월물	277.95	-2.81	-8.05	24,404.4	283,905
선물 12월물	277.15	-2.74	-7.80	67.7	37,565
7월물(mini)	278.54	-2.69	-7.70	2,668.5	63,277
8월물(mini)	278.12	-2.67	-7.64	41.5	10,030

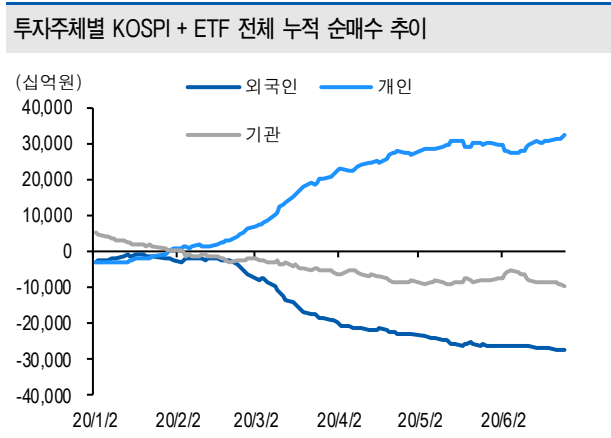


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	-0.37	-1.41	-1.78	-0.37%	
베이스스(mini)	-0.74	-0.96	-1.19	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.10	-0.70	-0.65	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.74	-1.26	-1.26	-0.18%	

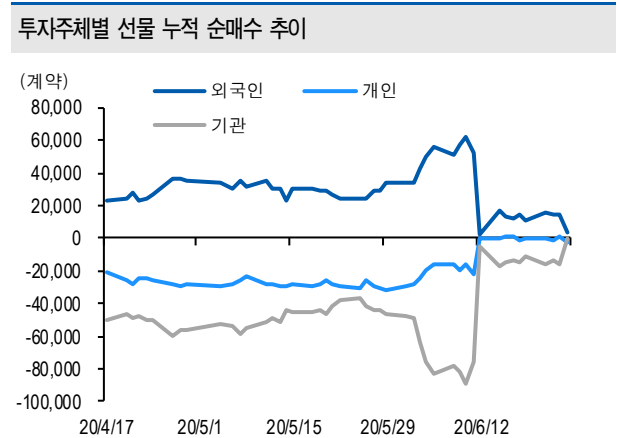


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-276.5	36.4	-240.1	0.0	-340.6	-534.0	-314.5	-3.3	2.8	-39.0	
개인	1,303.2	-33.3	1,269.9	0.0	1.9	-292.1	30.6	3.0	-2.8	-35.4	
기관	-1,045.4	-2.7	-1,048.1	-260.7	-230.6	792.4	283.7	0.5	-0.2	74.5	
금융투자	-665.3	-62.7	-728.0	-151.4	-80.9	1,378.9	284.0	1.0	-0.8	28.3	
투신	-90.1	-5.3	-95.4	0.0	-62.6	-715.2	-0.3	-0.4	0.2	-22.8	
은행+보험+기타금융	-34.8	43.8	9.0	0.0	-29.7	7.9	0.0	0.0	0.5	2.5	
연기금+국가지자체	-202.5	5.9	-196.6	-109.3	-17.6	120.8	0.0	0.0	0.0	66.4	
기타법인	18.7	-0.4	18.3	0.0	0.0	33.6	0.2	-0.2	0.1	-0.1	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

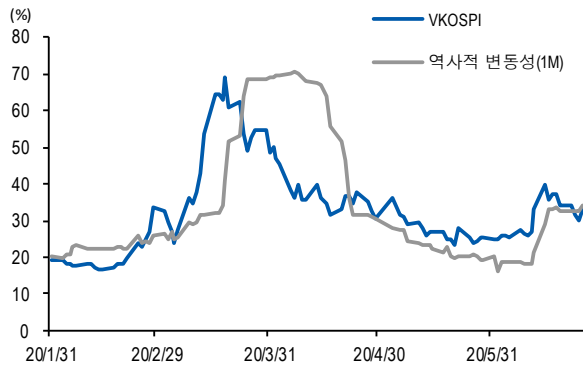
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	746,691	265.7	726,245	26.4%	지수옵션 전체	1,636,097	632.6	1,870,799			
Put	889,406	366.9	1,144,554	29.9%	PCR(금액기준)	1.38	VKOSPI	33.12%(+2.92%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	295.0(K+3)	1.16	-1.47	96,715	20,379	4,706	26.3	Put	290.0(K+1)	13.50	5.29	678	3,999	15	28.6
	292.5(K+2)	1.57	-1.91	78,329	13,386	2,057	26.3		287.5(K+0)	11.85	4.91	2,050	3,841	-151	29.5
	290.0(K+1)	2.16	-2.34	50,793	12,764	650	26.8		285.0(K-1)	10.15	4.32	4,182	4,919	-872	29.5
	287.5(K+0)	2.82	-2.88	43,707	8,839	441	26.9		282.5(K-2)	8.67	3.77	6,969	5,663	175	29.8
	285.0(K-1)	3.67	-3.44	25,839	7,824	87	27.3		280.0(K-3)	7.27	3.15	13,630	9,805	762	29.9

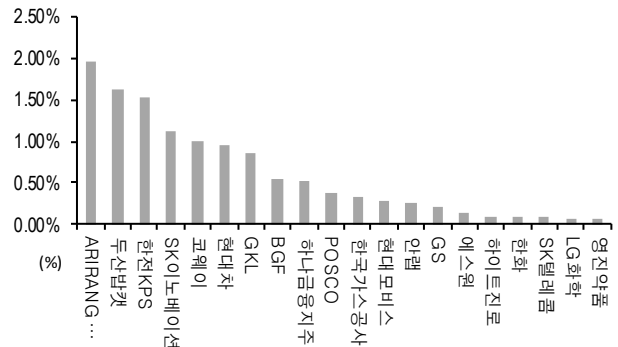
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,621,771	2,842.6	4,904,606	38,630	-65,953	-27,022	92,889	-39.0	-35.4	74.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	162,000	-3.57	28.4	114.3	12,417	-892	-0.08%	528	-44	-471	440	885
삼성 SDI	369,000	-2.64	200.6	92.3	12,250	-1,949	-0.32%	1,306	-1,458	312	954	2,283
삼성전자	51,700	-1.90	816.0	84.7	1,466,157	45,407	0.05%	-10,566	-10,975	22,612	16,896	-23,661
SK 하이닉스	84,500	-1.97	234.6	81.8	167,118	-9,619	0.03%	-922	-6,558	7,461	5,268	3,428
카카오	273,000	-3.19	179.7	72.5	32,116	-1,719	-0.35%	-55	-1,174	1,198	-265	1,744
기아차	32,550	-3.84	32.7	67.1	27,920	-7,489	-0.23%	-8,051	1,382	6,669	5,335	5,393
셀트리온	316,000	-0.94	191.8	66.6	48,385	-224	-0.09%	-547	-12	394	589	0
삼성전기	132,500	-2.93	44.0	56.9	22,574	-4,067	-0.24%	747	-1,143	415	1,009	1,764
엔씨소프트	908,000	-3.09	43.8	56.9	2,562	173	-0.39%	-134	236	-102	-4	-25
LG 화학	498,500	-4.13	154.3	56.0	34,502	-6,115	0.07%	-1,061	-2,447	3,635	1,512	4,904

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터