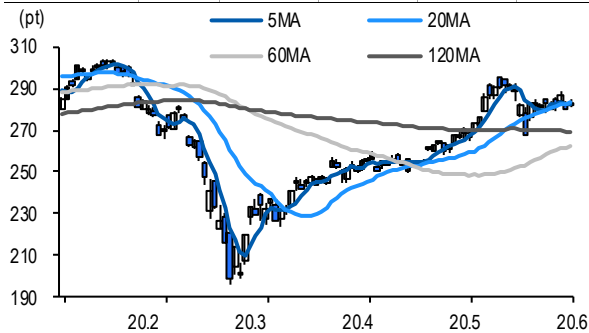
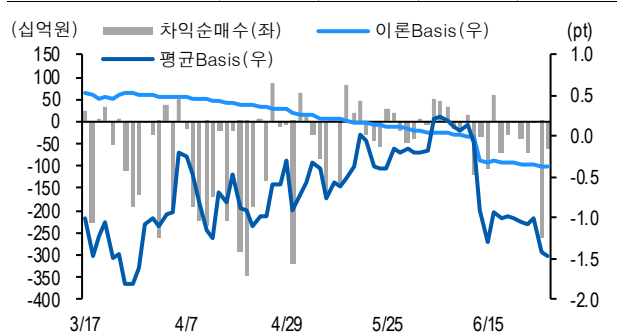


선물옵션시장 지표 2020.6.29

| Market Data (십억원, 계약) | | | | | |
|-----------------------|--------|--------|---------|----------|---------|
| | 증가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
| KOSPI200 | 283.38 | 1.30 | 3.65 | 6,091.5 | - |
| 선물 9월물 | 281.65 | 1.33 | 3.70 | 19,053.3 | 284,594 |
| 선물 12월물 | 281.00 | 1.39 | 3.85 | 33.2 | 37,581 |
| 7월물(mini) | 282.26 | 1.34 | 3.72 | 1,749.7 | 71,873 |
| 8월물(mini) | 282.16 | 1.45 | 4.04 | 13.4 | 16,108 |

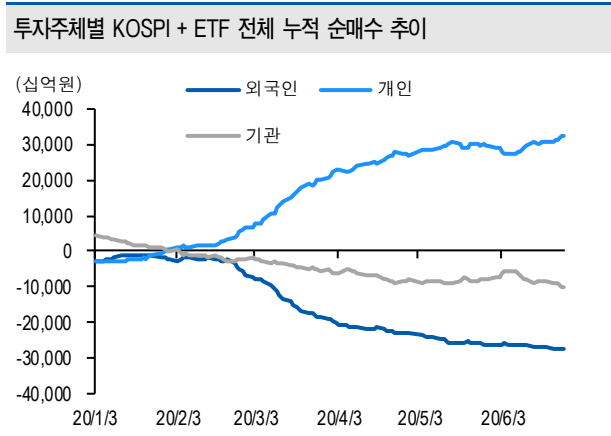


| 차익거래 관련 Market data (pt) | | | | |
|--------------------------|-------|-------|-------|--------|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
| K200 베이스 | -0.37 | -1.47 | -1.73 | -0.39% |
| 베이스(mini) | -0.75 | -0.90 | -1.12 | -0.05% |
| 제1스프레드(SP) | -0.09 | -0.74 | -0.75 | -0.23% |
| 합성선물 베이스(ATM) | -0.75 | -1.22 | -1.22 | -0.17% |

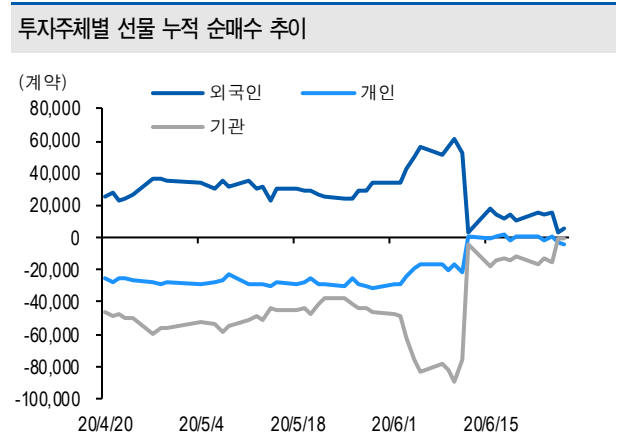


| 투자주체별 매매 동향 (십억원) | | | | | | | | | | |
|-------------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
| 외국인 | 61.6 | 46.1 | 107.8 | -9.9 | -9.3 | 201.1 | -27.0 | 2.1 | -2.6 | -2.4 |
| 개인 | 106.9 | 0.0 | 106.9 | 0.0 | -0.2 | -58.4 | -24.0 | -3.2 | 2.3 | 28.3 |
| 기관 | -164.7 | -47.4 | -212.1 | -51.9 | -188.5 | -90.0 | 51.2 | 1.1 | 0.5 | -27.2 |
| 금융투자 | -196.0 | 9.8 | -186.2 | -59.3 | -114.2 | -560.9 | 51.3 | 2.1 | 0.5 | 10.9 |
| 투신 | -18.1 | -35.8 | -53.9 | 0.0 | -32.1 | 464.4 | -0.1 | -0.7 | -0.1 | 25.5 |
| 은행+보험+기타금융 | -5.9 | -17.3 | -23.2 | -0.2 | -9.1 | 2.0 | 0.0 | -0.2 | 0.0 | -0.9 |
| 연기금+국가자자체 | 86.5 | -1.6 | 84.9 | 12.5 | -13.2 | 4.4 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -62.7 |
| 기타법인 | -3.8 | 1.3 | -2.5 | 0.0 | 0.2 | -52.7 | -0.2 | 0.0 | -0.1 | 1.3 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | (계약, 십억원) | | | |
|-----------|---------|-------|-----------|-------|-----------|-----------|--------|-----------------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 |
| Call | 683,352 | 244.3 | 733,441 | 24.9% | 지수옵션 전체 | 1,396,945 | 486.1 | 1,903,669 |
| Put | 713,593 | 241.8 | 1,170,228 | 30.4% | PCR(금액기준) | 0.99 | VKOSPI | 30.56%(-2.56%p) |

| | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|------|--------|--------|-------|-------|-------|-----|------------|------|--------|--------|-------|-------|-------|
| Call | 287.5(K+3) | 3.46 | 0.64 | 36,251 | 8,982 | 143 | 25.0 | Put | 282.5(K+1) | 6.05 | -2.62 | 11,023 | 6,467 | 804 | 27.7 |
| | 285.0(K+2) | 4.53 | 0.86 | 24,147 | 7,718 | -106 | 25.4 | | 280.0(K+0) | 5.04 | -2.23 | 15,113 | 9,916 | 111 | 28.5 |
| | 282.5(K+1) | 5.77 | 1.13 | 9,381 | 4,471 | -128 | 25.8 | | 277.5(K-1) | 4.26 | -1.93 | 12,552 | 5,148 | 591 | 29.7 |
| | 280.0(K+0) | 7.20 | 1.40 | 6,884 | 8,941 | 85 | 26.3 | | 275.0(K-2) | 3.45 | -1.83 | 23,409 | 8,671 | 1,093 | 30.2 |
| | 277.5(K-1) | 9.06 | 1.85 | 1,467 | 4,196 | 57 | 28.1 | | 272.5(K-3) | 2.87 | -1.64 | 22,473 | 6,264 | 8 | 31.2 |

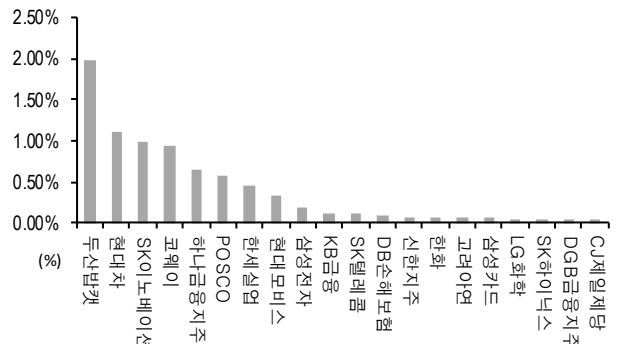
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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 | 3,542,857 | 2,572.2 | 5,199,679 | 295,073 | -16,378 | 23,614 | -8,551 | -2.4 | 28.3 | -27.2 |

| 종목명 | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균괴리율 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
|---------|-----------|---------|--------------|----------|------------|------------|-----------|---------|--------|--------|----------|----------|
| 삼성 SDI | 369,000 | 0.00 | 153.3 | 95.1 | 14,365 | 2,115 | -0.40% | 706 | 1,172 | -1,945 | -744 | -1,342 |
| 삼성전자 | 52,900 | 2.32 | 947.3 | 83.0 | 1,694,501 | 228,344 | 0.19% | -17,583 | 1,457 | 14,926 | -3,287 | -54,548 |
| 삼성전기 | 132,500 | 0.00 | 40.2 | 78.0 | 21,868 | -706 | -0.33% | -526 | 207 | 303 | 1,189 | 1,245 |
| SK 하이닉스 | 84,600 | 0.12 | 182.9 | 74.5 | 164,361 | -2,757 | 0.04% | -4,314 | 1,064 | 3,284 | 4,083 | 2,284 |
| 카카오 | 273,000 | 0.00 | 149.2 | 67.3 | 32,260 | 144 | -0.41% | 616 | 3,341 | -4,065 | -685 | -2,396 |
| NAVER | 270,000 | 0.75 | 168.2 | 66.8 | 45,775 | -617 | 0.02% | 983 | 1,810 | -3,173 | -2,184 | -464 |
| LG 이노텍 | 171,500 | 5.86 | 32.4 | 64.9 | 14,478 | 2,061 | -0.11% | -710 | -503 | 1,211 | 1,700 | -1,421 |
| KB 금융 | 34,950 | 3.56 | 40.4 | 61.8 | 152,299 | 18,131 | 0.11% | -3,684 | -229 | 3,993 | 4,483 | -10,083 |
| LG 화학 | 500,000 | 0.30 | 144.3 | 61.3 | 34,645 | 143 | 0.05% | -179 | 801 | -621 | 520 | -768 |
| 대림산업 | 82,300 | -0.24 | 7.4 | 57.5 | 10,371 | -399 | -0.03% | 696 | -274 | -427 | 241 | -521 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터