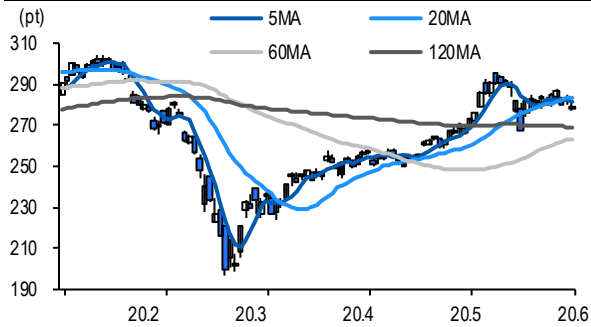
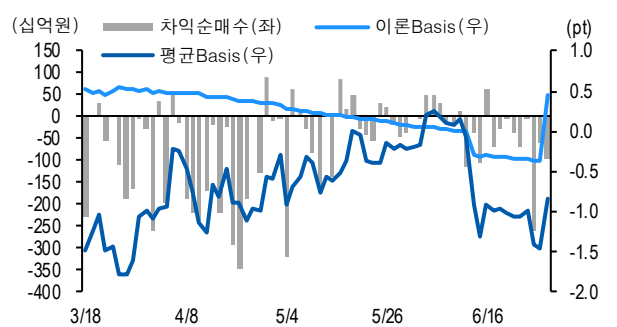


선물옵션시장 지표 2020.6.30

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	278.04	-1.88	-5.34	6,344.6	-
선물 9월물	278.15	-1.24	-3.50	23,275.3	284,743
선물 12월물	276.75	-1.51	-4.25	99.5	37,762
7월물(mini)	278.70	-1.26	-3.56	2,247.3	76,563
8월물(mini)	278.22	-1.40	-3.94	14.0	16,216

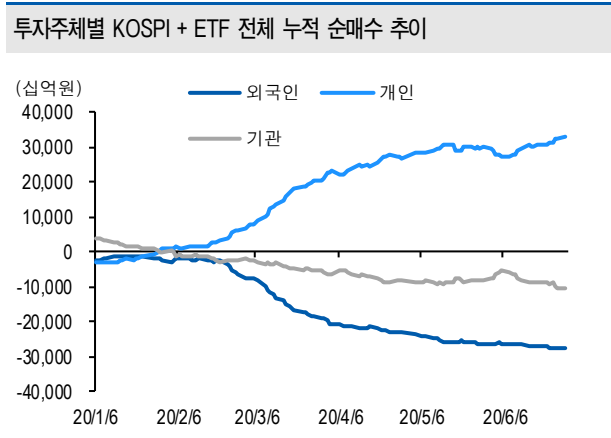


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.44	-0.85	0.11	-0.46%	
베이스스(mini)	0.06	-0.30	0.66	-0.13%	
제1스프레드(SP)	-0.10	-0.70	-0.70	-0.22%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.06	0.72	0.72	0.24%	

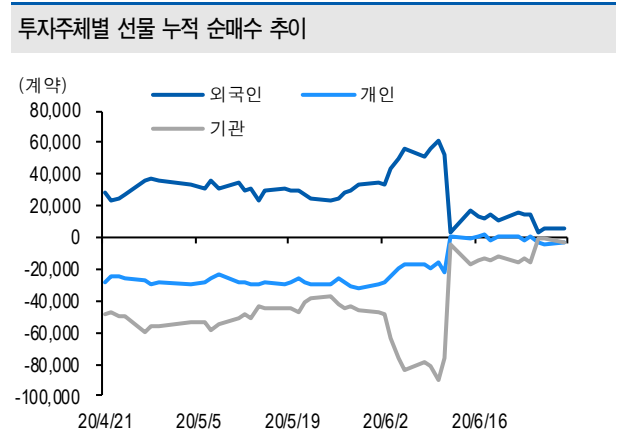


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵선	풋옵선	주식선물전체
외국인	-228.7	65.3	-163.3	-12.2	-207.2	25.4	-48.0	-0.8	-3.4	-2.8
개인	575.2	21.0	596.1	0.0	-0.9	51.4	3.7	-0.4	4.1	-32.7
기관	-351.8	-85.1	-436.9	-86.2	-27.5	-151.0	44.9	1.4	-1.3	37.5
금융투자	-241.8	-33.4	-275.1	-97.6	-4.4	246.2	45.3	1.8	-1.4	63.9
투신	-20.1	-99.3	-119.3	0.0	-10.1	-398.5	-0.3	-0.5	0.1	-62.2
은행+보험+기타금융	-24.5	44.0	19.6	0.0	-4.8	13.4	0.0	0.1	0.0	2.3
연기금+국가자자체	-17.7	-2.9	-20.7	11.5	1.4	-12.1	0.0	0.0	0.0	33.4
기타법인	5.3	-1.2	4.1	0.0	0.0	74.3	-0.6	-0.2	0.6	-2.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

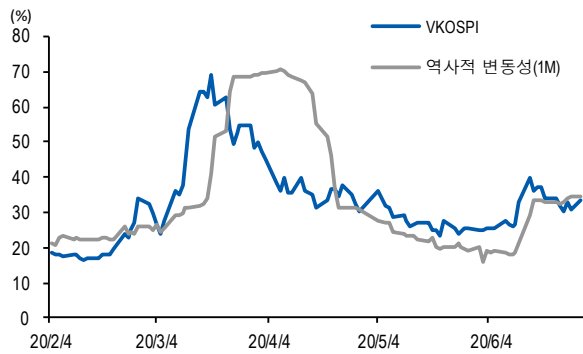
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	792,772	263.5	743,507	29.1%	지수옵션 전체	1,718,590	626.6	1,955,549
Put	925,818	363.1	1,212,042	30.2%	PCR(금액기준)	1.38	VKOSPI	33.58%(+3.02%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	1.58	-0.97	101,383	14,758	249	28.7	Put	285.0(K+1)	9.56	2.26	1,562	4,684	-64	27.9
	287.5(K+2)	2.20	-1.26	64,191	9,309	327	29.2		282.5(K+0)	7.77	1.72	2,590	6,624	157	27.2
	285.0(K+1)	3.02	-1.51	45,703	8,656	938	29.9		280.0(K-1)	6.47	1.43	16,189	9,487	-429	28.3
	282.5(K+0)	4.03	-1.74	26,828	5,127	656	30.8		277.5(K-2)	5.39	1.13	15,712	5,662	514	29.6
	280.0(K-1)	5.29	-1.91	12,721	8,907	-34	32.0		275.0(K-3)	4.47	1.02	24,529	8,973	302	30.8

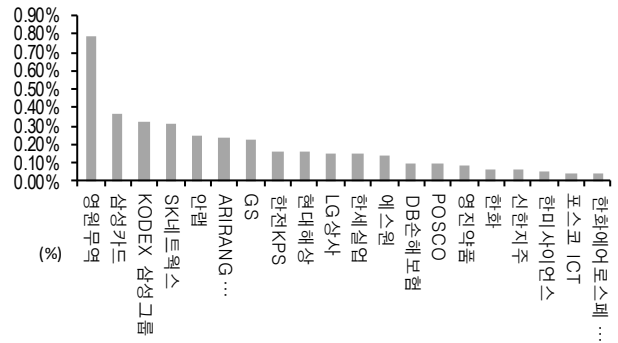
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,613,064	2,762.2	5,190,486	-9,193	-15,063	-42,381	58,513	-2.8	-32.7	37.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	490,500	-1.90	224.5	100.3	31,963	-2,682	0.03%	-356	-1,531	1,905	2,153	1,716
NAVER	264,500	-2.04	211.1	97.3	46,129	354	0.02%	131	-44	-16	-1,344	2,068
삼성 SDI	362,000	-1.90	140.9	91.7	13,570	-795	-0.22%	259	-382	172	204	545
삼성전자	52,400	-0.95	802.8	85.9	1,693,097	-1,404	0.04%	-1,684	-21,257	23,274	31,687	-9,165
SK 하이닉스	83,800	-0.95	194.5	78.8	154,861	-9,500	0.01%	1,648	-143	-1,503	5,728	2,440
삼성전기	128,500	-3.02	41.7	73.9	20,465	-1,403	-0.34%	-1,810	176	1,630	723	1,934
카카오	268,000	-1.83	154.6	73.6	30,446	-1,814	-0.22%	1,009	-695	-236	489	275
LG 이노텍	171,500	0.00	23.0	69.3	15,767	1,289	-0.07%	-1,614	-149	1,738	476	365
기아차	32,150	-2.58	25.6	63.1	29,126	-74	-0.33%	580	-4,924	4,494	6,157	2,718
엔씨소프트	888,000	-2.20	41.8	57.4	2,529	-336	-0.20%	-67	161	-94	109	32

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터