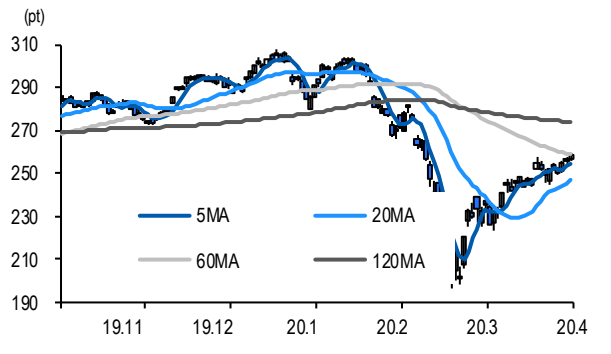


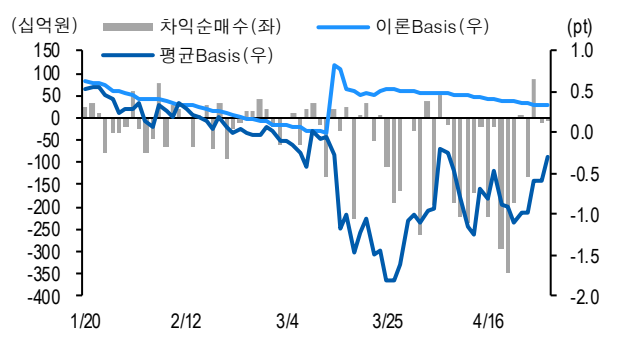


선물옵션시장 지표 2020.5.4

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	258.15	0.69	1.76	6,516.4	-
선물 6월물	258.10	0.82	2.10	19,090.7	333,334
선물 9월물	257.40	0.90	2.30	11.4	8,272
5월물(mini)	258.04	0.73	1.88	1,582.7	71,467
6월물(mini)	257.66	0.65	1.80	99.4	46,225

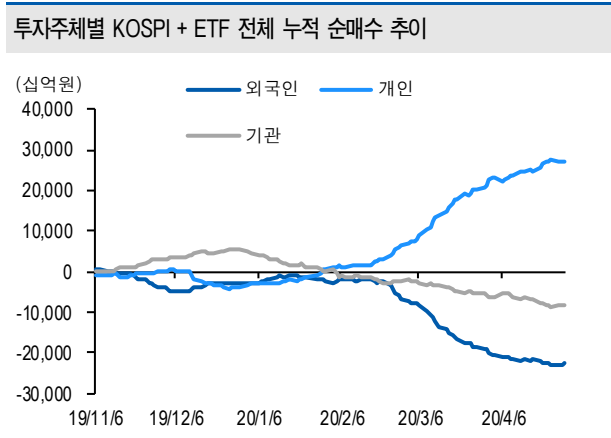


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.33	-0.30	-0.05	-0.25%	
베이스스(mini)	0.12	-0.16	-0.11	-0.11%	
제1스프레드(SP)	-0.13	-0.68	-0.65	-0.21%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	-0.06	-0.06	-0.07%	

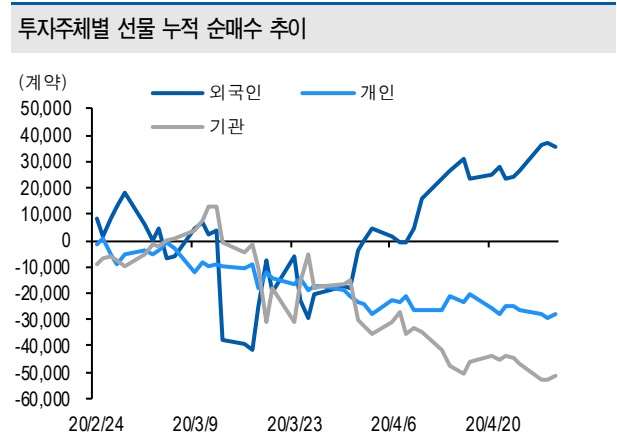


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	233.8	-4.9	228.9	0.0	195.3	-95.2	11.5	0.2	-7.0	6.7
개인	-482.8	48.4	-434.4	0.0	-0.2	70.0	4.9	1.8	1.9	-8.4
기관	249.8	-49.0	200.7	-5.1	-21.7	58.8	-17.5	-2.0	5.2	1.0
금융투자	121.1	-40.2	80.9	0.0	-0.1	-12.9	-16.9	-2.2	4.8	6.5
투신	-3.5	-4.7	-8.2	0.0	-8.1	11.7	-0.6	0.2	0.4	10.4
은행+보험+기타금융	-16.1	-25.2	-41.3	0.0	-45.2	56.9	0.0	-0.1	0.0	-1.0
연기금+국가자재	143.2	16.7	159.9	-5.1	28.9	3.0	0.0	0.0	0.0	-14.8
기타법인	-0.7	4.9	4.1	0.0	-0.2	-33.5	1.0	0.0	-0.1	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	734,482	249.9	860,793	21.5%	지수옵션 전체	1,379,962	453.4	1,983,296
Put	645,480	203.5	1,122,503	28.2%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	30.51%(-2.13%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	265.0(K+3)	2.04	0.15	112,365	26,081	398	21.3	Put	260.0(K+1)	6.09	-1.53	3,322	5,532	192	24.0
	262.5(K+2)	2.96	0.25	46,794	11,103	-651	22.0		257.5(K+0)	5.04	-1.34	6,161	2,192	761	25.2
	260.0(K+1)	4.14	0.38	22,320	17,969	263	22.9		255.0(K-1)	4.16	-1.21	12,596	5,224	2,117	26.4
	257.5(K+0)	5.63	0.62	7,645	7,492	-127	24.3		252.5(K-2)	3.48	-1.09	11,417	4,199	965	27.8
	255.0(K-1)	7.25	0.70	2,809	8,663	-237	25.5		250.0(K-3)	2.91	-0.98	22,522	8,408	529	29.2

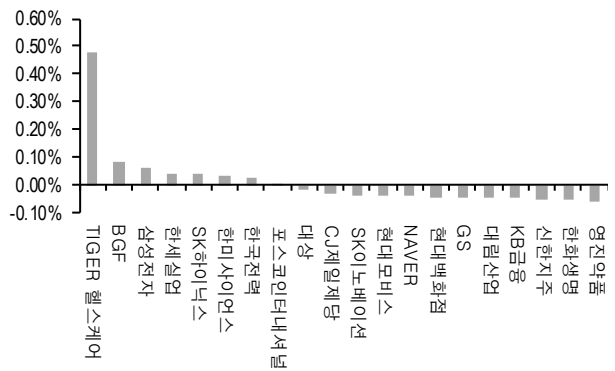
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,878,418	1,721.9	4,803,908	60,441	43,652	-7,195	-37,689	6.7	-8.4	1.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	83,900	0.36	234.3	74.7	234,523	31,054	0.04%	2,418	-9,993	7,660	7,166	-14,512
삼성전자	50,000	-0.40	446.9	57.4	1,462,437	25,497	0.06%	14,431	-10,074	-4,671	24,702	-23,465
하나금융지주	27,800	1.28	33.0	50.4	127,969	-69	-0.08%	2,604	2,831	-5,448	-1,828	-1,220
삼성전기	113,000	2.73	65.5	45.3	45,181	-764	-0.27%	-549	2,437	-1,884	-1,054	-225
호텔신라	85,200	4.16	76.8	44.6	26,214	-443	-0.24%	-1,329	-3,620	5,150	3,663	404
GS 건설	25,250	-0.20	5.9	44.2	34,651	68	-0.14%	1,575	-194	-1,381	-375	-1,005
삼성 SDI	286,000	2.14	77.9	43.4	10,983	60	-0.14%	12	17	-41	-980	504
대림산업	87,800	0.11	22.8	41.7	13,544	-1,324	-0.05%	-1,222	-426	1,468	-110	1,586
현대차	93,400	0.11	44.5	40.3	82,466	4,485	-0.10%	436	406	-797	1,054	-705
LG 이노텍	131,500	-3.66	19.5	38.4	9,886	683	-0.72%	1,345	849	-2,032	-1,485	95

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터