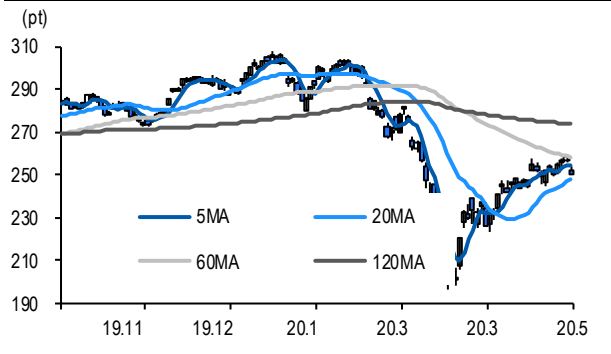
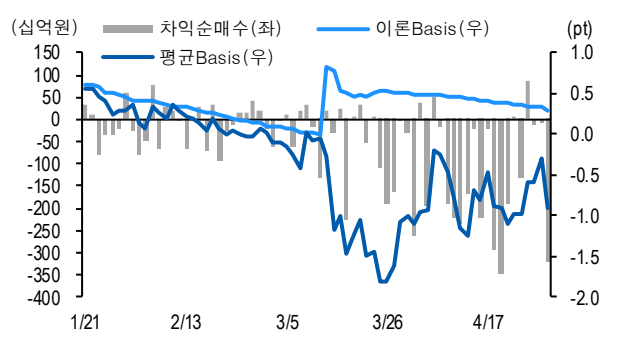


선물옵션시장 지표 2020.5.6

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	250.60	-2.92	-7.55	6,793.1	-
선물 6월물	249.60	-3.29	-8.50	22,805.6	342,075
선물 9월물	248.90	-3.30	-8.50	11.1	8,895
5월물(mini)	250.08	-3.08	-7.96	1,310.1	76,423
6월물(mini)	249.60	-3.29	-8.06	197.1	48,505

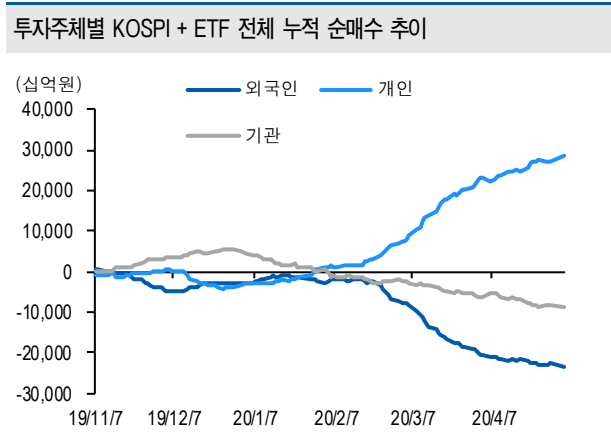


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.29	-0.91	-1.00	-0.48%	
베이스스(mini)	0.08	-0.55	-0.52	-0.25%	
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.65	-0.80	-0.20%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	-0.57	-0.57	-0.26%	

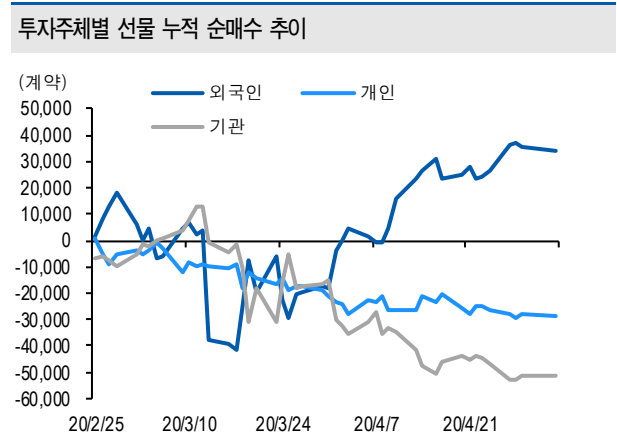


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-941.3	-20.7	-962.1	-138.5	-656.1	63.4	-189.3	-3.4	7.0	-43.7	
개인	1,699.3	-2.8	1,696.5	0.0	0.3	-68.5	7.6	0.8	-3.3	1.2	
기관	-805.9	25.5	-780.4	-181.2	-78.3	15.4	181.3	2.6	-3.7	42.6	
금융투자	-497.4	133.3	-364.1	-74.8	-38.3	721.7	183.7	2.6	-3.5	-0.7	
투신	-101.3	-11.1	-112.5	0.0	-58.8	-760.7	-2.5	-0.3	-0.1	-29.3	
은행+보험+기타금융	29.3	-100.5	-71.1	0.0	20.5	7.2	0.0	0.3	-0.1	1.1	
연기금+국가자재	-201.1	-2.0	-203.1	-106.4	6.6	47.2	0.1	0.0	0.0	71.5	
기타법인	47.9	-2.6	45.3	0.0	0.0	-10.3	0.4	-0.1	0.0	0.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





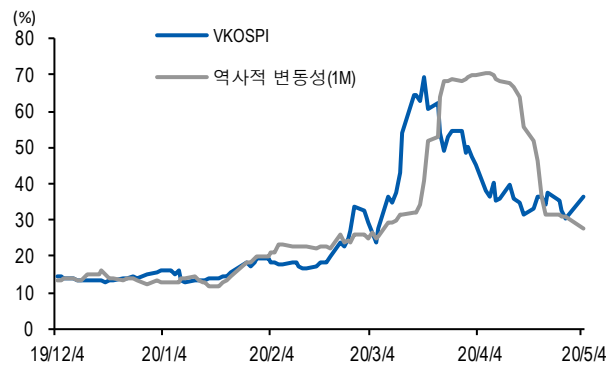
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	743,356	178.6	880,336	26.0%	지수옵션 전체	1,592,028	483.6	2,076,593
Put	848,672	305.0	1,196,257	33.6%	PCR(금액기준)	1.71	VKOSPI	36.36%(+5.85%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	265.0(K+3)	0.56	-1.48	99,525	28,613	2,532	25.4	Put	260.0(K+1)	11.35	5.26	839	5,428	-104	31.0
	262.5(K+2)	0.92	-2.04	78,831	14,450	3,347	25.9		257.5(K+0)	9.59	4.55	4,892	1,858	-334	31.4
	260.0(K+1)	1.40	-2.74	93,464	19,495	1,526	26.3		255.0(K-1)	8.00	3.84	3,725	4,631	-593	31.9
	257.5(K+0)	2.12	-3.51	55,034	9,475	1,983	27.1		252.5(K-2)	6.65	3.17	6,321	3,851	-348	32.7
	255.0(K-1)	3.05	-4.20	20,380	9,739	1,076	28.0		250.0(K-3)	5.55	2.64	16,231	8,874	466	34.0

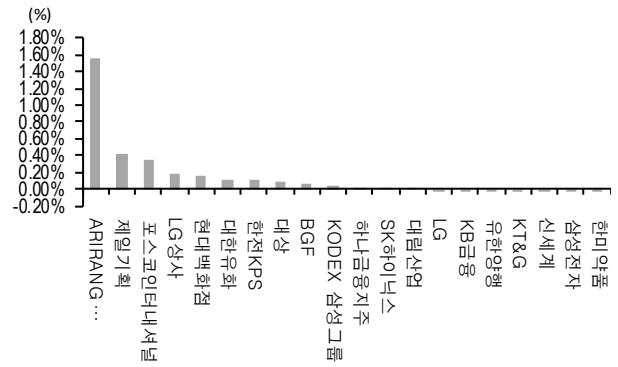
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,843,912	1,794.2	4,727,916	-75,992	-107,364	27,459	71,479	-43.7	1.2	42.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	83,200	-2.35	48.5	65.4	23,448	-2,766	-0.29%	992	-3,831	2,836	1,058	594
SK 하이닉스	81,100	-3.34	231.9	53.9	203,893	-30,630	0.00%	771	1,990	-2,607	-8,218	18,326
현대차	91,100	-2.46	59.8	51.7	77,662	-4,804	-0.14%	177	-980	803	-3,372	281
신세계	264,000	-0.75	13.1	51.3	4,286	975	-0.02%	-304	-21	325	683	-712
카카오	186,000	1.64	93.4	49.5	37,918	2,970	-0.13%	-989	2,030	-1,275	430	-1,785
삼성 SDI	277,500	-2.97	71.9	45.3	9,485	-1,498	-0.09%	-395	-1,381	1,775	420	1,858
롯데쇼핑	96,000	-3.90	8.3	42.5	5,955	-65	-0.19%	-17	31	-14	-35	17
GS 건설	24,300	-3.76	5.4	42.3	34,492	-159	-0.04%	-1,371	212	1,159	230	923
KODEX 삼성그룹	6,205	-3.35	0.3	42.1	49	12	0.05%	0	14	-14	-14	0
LG 이노텍	130,500	-0.76	10.9	39.7	9,524	-362	-0.49%	-84	-224	303	2,046	-1,402

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표