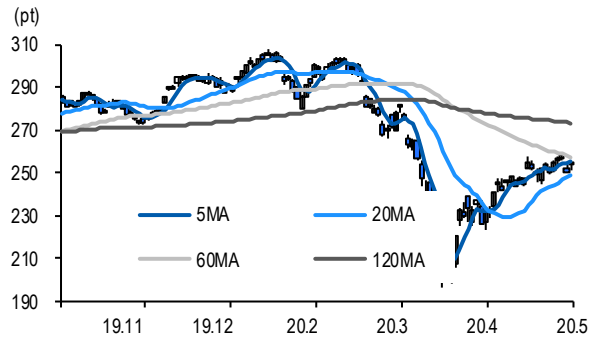


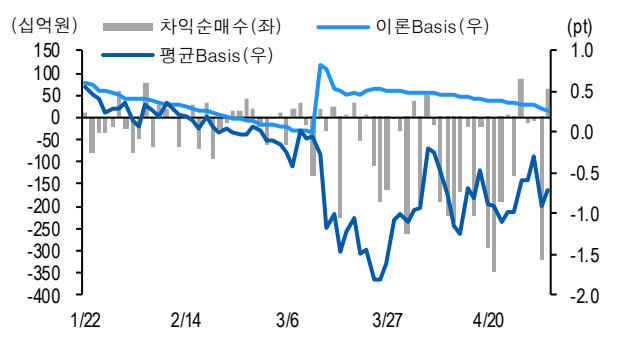


선물옵션시장 지표 2020.5.7

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	255.00	1.76	4.40	5,297.8	-
선물 6월물	255.20	2.24	5.60	17,970.7	341,867
선물 9월물	254.35	2.19	5.45	11.8	8,860
5월물(mini)	255.42	2.14	5.34	1,141.1	73,550
6월물(mini)	255.02	2.17	5.42	107.3	50,538

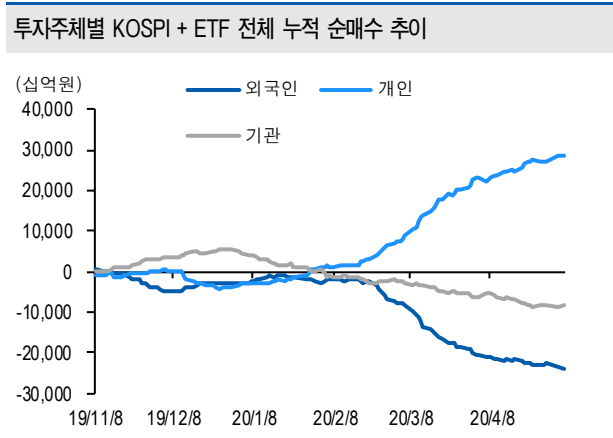


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.28	-0.70	0.20	-0.38%	
베이스(mini)	0.06	-0.29	0.42	-0.14%	
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.66	-0.70	-0.20%	
합성선물 베이스(ATM)	0.06	0.41	0.41	0.14%	

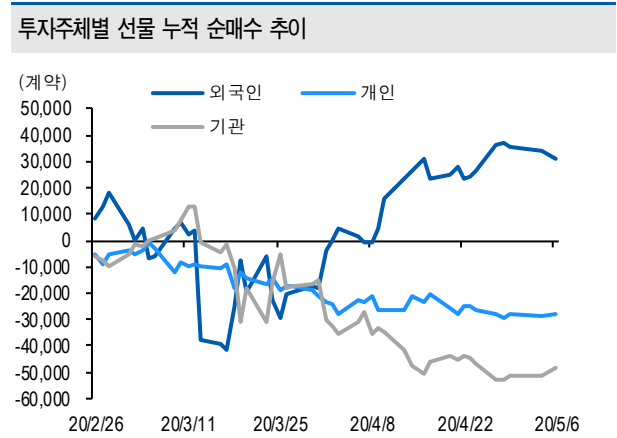


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-314.8	2.8	-312.0	-5.0	-306.8	-261.9	85.3	4.6	-4.6	4.2	
개인	0.5	-128.0	-127.5	0.0	-0.8	50.5	-5.6	-1.9	3.1	59.8	
기관	308.5	126.2	434.6	69.3	-35.1	194.3	-79.9	-2.7	2.0	-65.3	
금융투자	92.8	137.1	230.0	-12.6	-13.7	-486.3	-79.0	-2.2	2.0	0.9	
투신	7.1	17.1	24.2	0.0	-5.7	729.4	-0.9	-0.5	0.0	22.0	
은행+보험+기타금융	27.0	-20.6	6.4	0.0	1.4	44.2	0.0	0.0	0.0	-0.2	
연기금+국가지자체	197.4	-14.1	183.3	89.9	-21.5	-93.1	0.0	0.0	0.0	-88.0	
기타법인	5.8	-1.2	4.5	0.0	0.1	17.2	0.2	0.1	-0.4	1.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



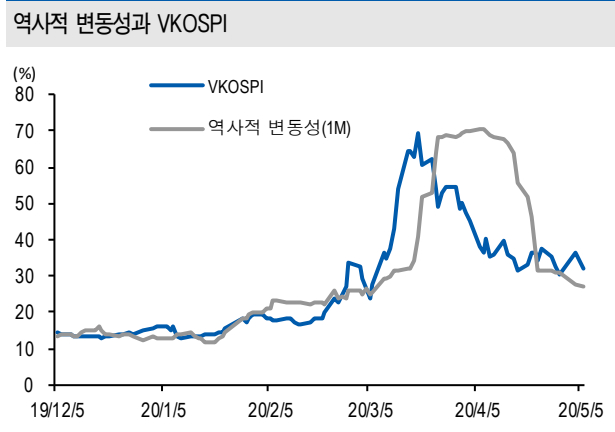


선물옵션시장 지표

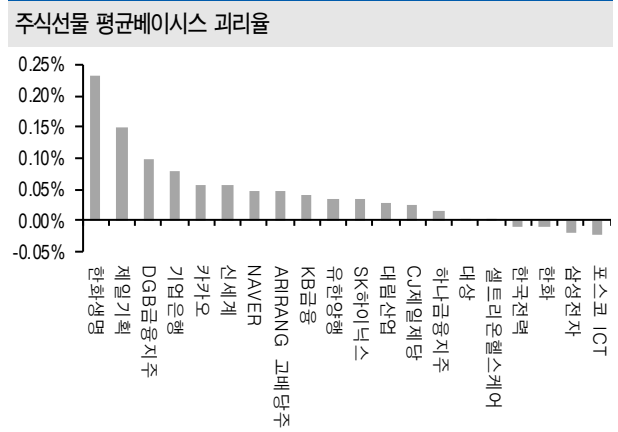
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	632,095	174.8	884,819	26.5%	지수옵션 전체	1,508,739	389.1	2,119,143		
Put	876,644	214.3	1,234,324	33.3%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	31.81%(-4.55%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	257.5(K+3)	3.19	1.07	64,826	10,347	872	26.8	Put	252.5(K+1)	3.28	-3.37	11,649	5,151	1,300	28.0
	255.0(K+2)	4.57	1.52	28,640	9,840	101	28.4		250.0(K+0)	2.59	-2.96	21,946	9,119	245	29.7
	252.5(K+1)	6.19	1.99	10,172	6,578	-474	30.2		247.5(K-1)	2.06	-2.59	23,183	7,149	976	31.5
	250.0(K+0)	8.00	2.40	4,342	9,902	2	32.0		245.0(K-2)	1.64	-2.24	46,220	17,830	732	33.2
	247.5(K-1)	9.81	2.67	244	5,332	-1	32.9		242.5(K-3)	1.29	-1.95	37,806	9,614	868	34.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	2,374,426	1,576.7	4,879,037	151,121	12,152	78,991	-93,348	4.2	59.8	-65.3		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	82,700	1.97	183.6	67.6	227,078	23,185	0.03%	-6,707	20,118	-13,521	-11,034	-14,247
카카오	200,500	7.80	224.1	57.0	49,237	11,319	0.06%	-1,166	5,627	-4,712	4,579	-12,338
현대차	93,200	2.31	49.4	51.2	78,472	810	-0.16%	-2,392	2,860	-468	466	-2,282
NAVER	212,000	6.27	93.0	47.1	40,720	3,376	0.05%	-49	126	-117	637	-2,048
GS 건설	24,800	2.06	4.5	45.4	30,592	-3,900	-0.11%	2,787	-4,052	1,253	-100	1,170
호텔신라	84,700	1.80	22.5	44.6	23,960	512	-0.27%	978	-789	-179	661	269
삼성전자	49,200	1.44	381.7	43.4	1,486,905	42,452	-0.02%	17,864	44,202	-62,213	2,472	-55,848
현대건설	34,800	2.96	11.7	43.3	19,422	1,740	-0.09%	1,363	395	-1,758	-2,340	-4,249
롯데쇼핑	97,300	1.35	5.9	42.3	7,277	1,322	-0.14%	-655	57	598	1,002	-405
기아차	29,000	1.05	17.6	38.0	71,884	6,807	-0.04%	-21	1,593	-1,572	-6,942	-2,291

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

