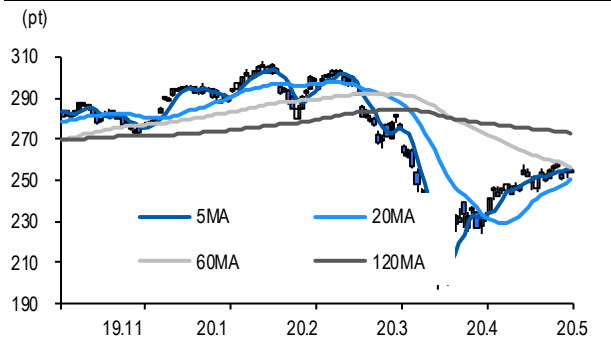


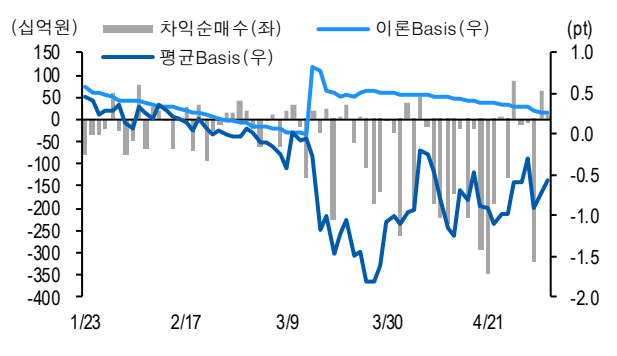


선물옵션시장 지표 2020.5.8

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	254.46	-0.21	-0.54	4,606.2	-
선물 6월물	253.55	-0.65	-1.65	16,288.1	342,058
선물 9월물	253.20	-0.45	-1.15	8.7	8,861
5월물(mini)	254.00	-0.56	-1.42	1,175.9	74,853
6월물(mini)	254.10	-0.43	-0.92	152.8	49,996

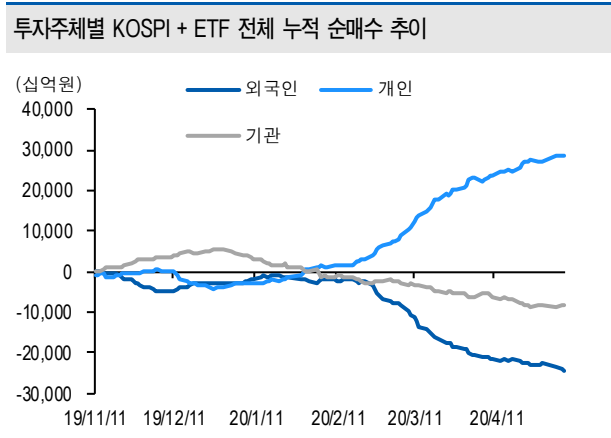


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.26	-0.56	-0.91	-0.32%	
베이스(mini)	0.05	-0.19	-0.46	-0.10%	
제1스프레드(SP)	-0.15	-0.67	-0.70	-0.20%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	-0.44	-0.44	-0.19%	

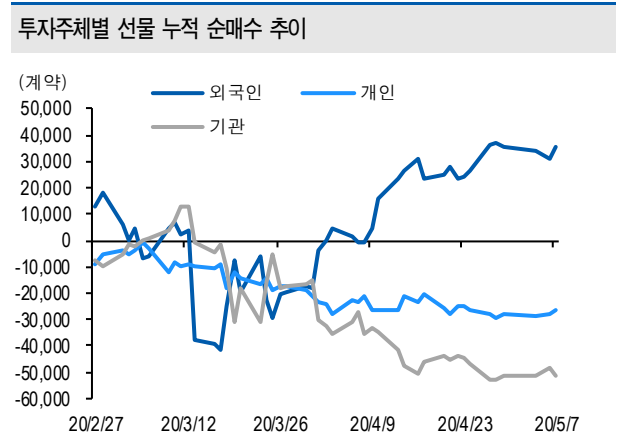


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-321.1	7.6	-313.5	-16.3	-311.9	131.1	155.6	-0.8	1.6	11.2	
개인	253.3	6.4	259.7	0.0	-1.1	119.5	9.5	2.1	-3.6	-16.3	
기관	57.5	-15.0	42.5	27.1	-89.1	-208.1	-165.6	-1.1	2.2	5.7	
금융투자	136.3	13.2	149.5	-1.3	-7.3	-113.0	-165.4	-0.6	2.2	-16.5	
투신	-78.4	-6.1	-84.5	0.0	-65.7	-78.5	-0.3	-0.5	0.0	5.0	
은행+보험+기타금융	2.3	-13.7	-11.4	0.0	-8.7	19.1	0.0	0.0	0.0	0.0	
연기금+국가지자체	4.1	0.1	4.2	28.4	-5.2	-35.6	0.0	0.0	0.0	17.1	
기타법인	10.3	1.4	11.6	0.0	0.0	-42.5	0.6	-0.2	-0.1	-0.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





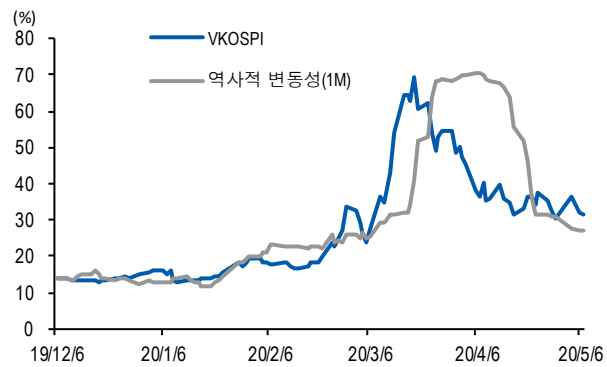
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	683,832	202.1	905,159	22.9%	지수옵션 전체	1,396,648	402.6	2,167,944
Put	712,816	200.6	1,262,785	30.6%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	31.31%(-0.50%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	262.5(K+3)	0.83	-0.47	93,173	14,578	72	22.6	Put	257.5(K+1)	5.70	0.43	2,758	1,961	-43	26.7
	260.0(K+2)	1.40	-0.68	129,860	19,717	-735	22.9		255.0(K+0)	4.36	0.21	14,645	5,919	937	27.4
	257.5(K+1)	2.23	-0.96	69,302	11,071	724	23.3		252.5(K-1)	3.37	0.09	27,033	6,632	1,481	28.8
	255.0(K+0)	3.38	-1.19	42,437	9,534	-306	24.0		250.0(K-2)	2.55	-0.04	43,411	10,567	1,448	29.9
	252.5(K-1)	4.85	-1.34	7,139	6,635	57	25.1		247.5(K-3)	1.95	-0.11	41,725	8,082	933	31.3

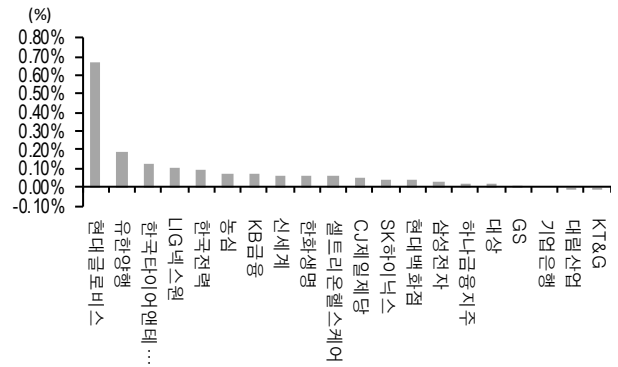
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,291,483	1,608.4	4,855,664	-23,373	26,460	-29,773	2,648	11.2	-16.3	5.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	82,500	-0.24	148.9	67.7	230,995	3,917	0.04%	-1,523	-1,478	2,969	1,267	-1,909
삼성전자	48,750	-0.91	408.4	60.4	1,419,659	-67,246	0.02%	15,741	-26,263	10,520	-8,265	15,025
카카오	206,500	2.99	307.4	57.5	44,987	-4,250	-0.06%	145	-3,724	4,021	-2,866	4,498
롯데쇼핑	94,500	-2.88	9.9	57.1	2,048	-5,229	-0.44%	805	191	-996	-1,264	1,932
GS 건설	24,900	0.40	5.4	50.6	30,379	-213	-0.11%	-637	49	593	-211	325
현대건설	34,850	0.14	10.8	50.6	19,879	457	-0.16%	-1,276	771	505	297	340
삼성 SDI	282,000	-0.18	34.8	47.8	8,787	-111	-0.07%	64	-47	-98	-205	-152
NAVER	216,000	1.89	85.8	42.5	33,403	-7,317	-0.01%	-325	-1,882	2,200	-25	1,749
삼성전기	114,500	0.44	26.3	39.9	48,041	917	-0.28%	-291	-147	391	1,150	-560
기아차	29,050	0.17	14.7	38.0	69,748	-2,136	-0.09%	-1,357	2,270	-913	-2,024	1,110

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터