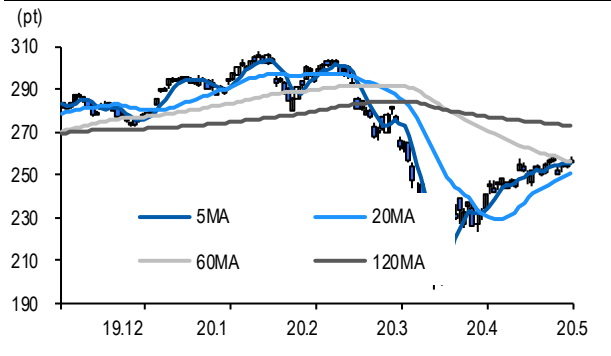


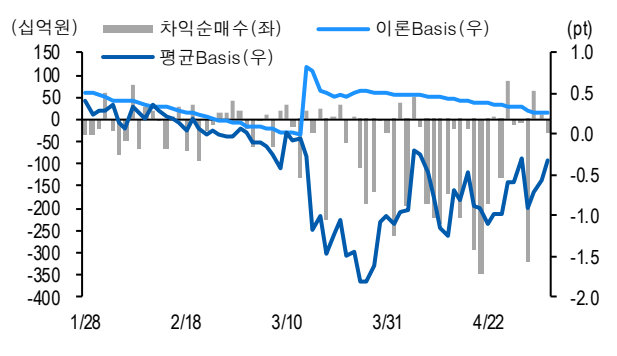


선물옵션시장 지표 2020.5.11

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	256.62	0.85	2.16	5,484.9	-
선물 6월물	256.40	1.12	2.85	15,898.1	345,464
선물 9월물	255.70	0.99	2.50	14.7	8,933
5월물(mini)	255.70	0.67	1.70	1,060.7	80,273
6월물(mini)	256.28	1.07	2.18	88.0	50,055

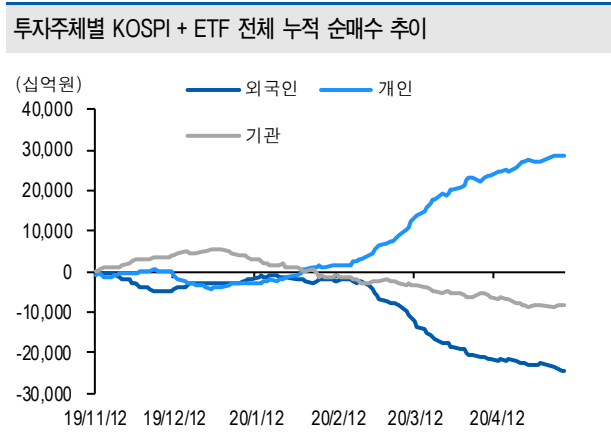


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.26	-0.32	-0.22	-0.23%	
베이스(mini)	0.05	-0.02	-0.92	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.69	-0.65	-0.21%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.06	0.06	0.01%	

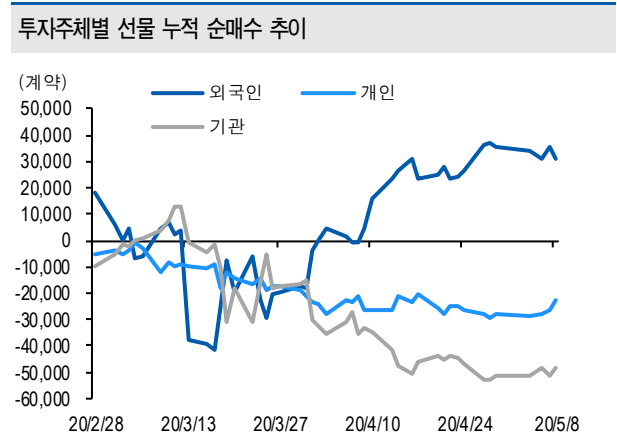


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	43.7	11.2	54.9	-14.6	46.7	-411.5	138.3	-4.4	-5.8	24.7	
개인	-242.4	-23.7	-266.1	0.0	1.8	213.4	0.0	5.3	-0.1	56.9	
기관	171.7	4.8	176.6	-14.0	-74.6	226.9	-138.2	-1.0	6.2	-82.7	
금융투자	181.7	48.8	230.6	0.0	-3.7	228.3	-138.3	-0.9	6.4	-35.7	
투신	-25.3	19.0	-6.3	0.0	-31.4	-7.5	0.2	-0.2	-0.1	24.1	
은행+보험+기타금융	-19.7	-41.6	-61.3	0.0	-23.1	-7.6	0.0	0.1	0.0	0.2	
연기금+국가자재	44.1	-33.7	10.4	-14.0	4.7	13.7	0.0	0.0	0.0	-71.3	
기타법인	26.9	8.3	35.2	0.0	0.0	-28.8	-0.1	0.1	-0.3	1.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	866,424	238.9	932,302	21.6%	지수옵션 전체	1,692,042	411.1	2,254,251		
Put	825,618	172.2	1,321,949	27.5%	PCR(금액기준)	0.72	VKOSPI	28.77%(-2.54%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	262.5(K+3)	0.97	0.14	110,791	14,128	-450	21.2	Put	257.5(K+1)	3.68	-2.02	18,060	4,125	2,164	22.9
	260.0(K+2)	1.74	0.34	138,116	19,785	68	21.9		255.0(K+0)	2.68	-1.68	45,764	8,460	2,541	24.4
	257.5(K+1)	2.86	0.63	47,114	11,588	517	22.9		252.5(K-1)	1.95	-1.42	56,378	8,420	1,788	26.1
	255.0(K+0)	4.36	0.98	18,288	9,632	98	24.5		250.0(K-2)	1.43	-1.12	76,226	14,194	3,627	27.8
	252.5(K-1)	6.15	1.30	3,237	6,467	-168	26.3		247.5(K-3)	1.03	-0.92	58,447	9,361	1,279	29.3

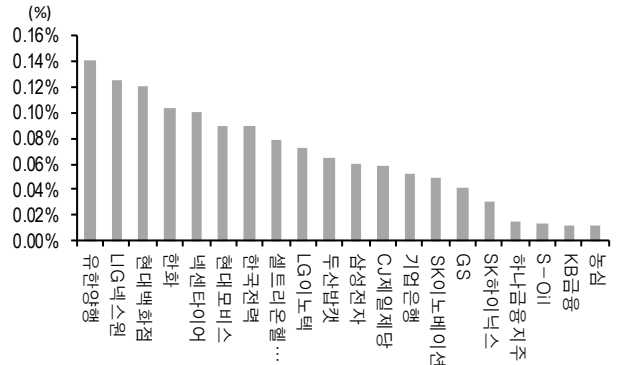
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,395,210	1,726.8	4,993,573	137,909	27,853	84,089	-114,020	24.7	56.9	-82.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	205,500	-0.48	156.5	53.8	41,036	-3,951	-0.08%	-800	1,131	-326	-2,545	3,212
삼성전자	48,850	0.21	394.7	53.0	1,461,729	42,070	0.06%	31,619	89,800	-121,678	-27,644	-105,765
삼성전기	118,500	3.49	55.2	52.0	56,962	8,921	-0.09%	-850	-385	1,239	5,182	-9,240
호텔신라	82,000	-0.24	23.4	50.7	20,798	-1,654	-0.42%	3,264	42	-3,311	-3,228	213
SK 하이닉스	85,100	3.15	210.9	49.7	250,346	19,351	0.03%	-100	2,915	-2,850	-4,313	-8,081
LG 이노텍	137,500	4.17	26.8	41.8	14,283	4,693	0.07%	108	-436	337	263	-3,560
CJ	79,400	-5.25	5.0	40.6	11,672	-3,428	-0.19%	387	189	-516	-586	70
현대차	94,600	2.16	64.1	39.1	75,139	-2,339	-0.04%	1,349	5,473	-6,817	-4,240	-3,022
NAVER	213,500	-1.16	56.5	38.2	26,952	-6,451	-0.10%	29	-912	923	-904	2,771
삼성 SDI	286,000	1.42	50.9	38.1	10,068	1,281	-0.08%	280	514	-828	579	-1,432

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터