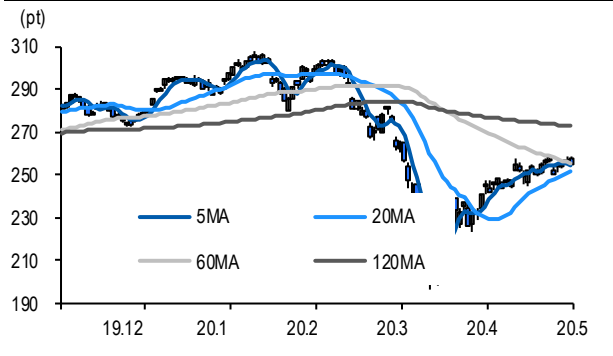


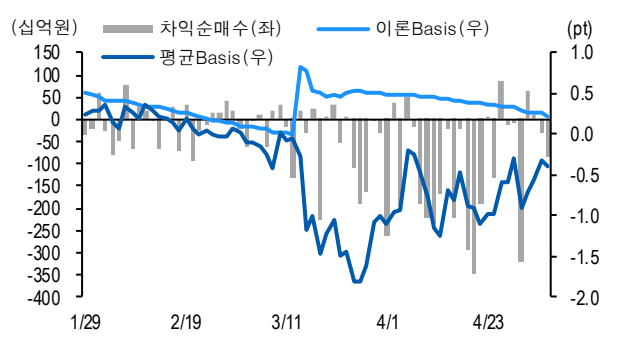


선물옵션시장 지표 2020.5.12

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	254.95	-0.65	-1.67	5,160.4	-
선물 6월물	254.25	-0.84	-2.15	17,460.2	349,344
선물 9월물	253.55	-0.84	-2.15	9.4	9,209
5월물(mini)	254.74	-0.38	-0.96	1,053.7	75,381
6월물(mini)	254.38	-0.79	-1.90	114.2	56,163

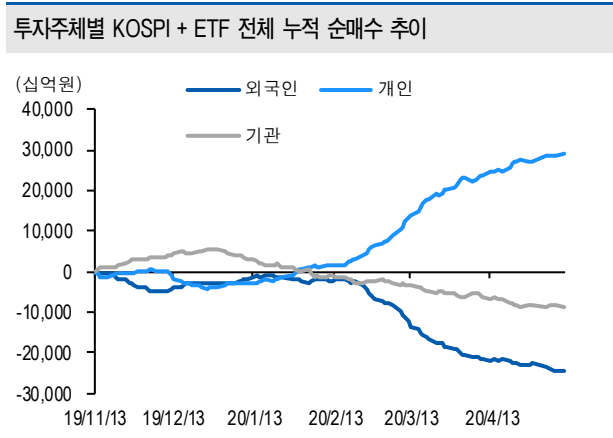


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.23	-0.39	-0.70	-0.24%	
베이스스(mini)	0.02	-0.08	-0.21	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.63	-0.70	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	-0.28	-0.28	-0.12%	

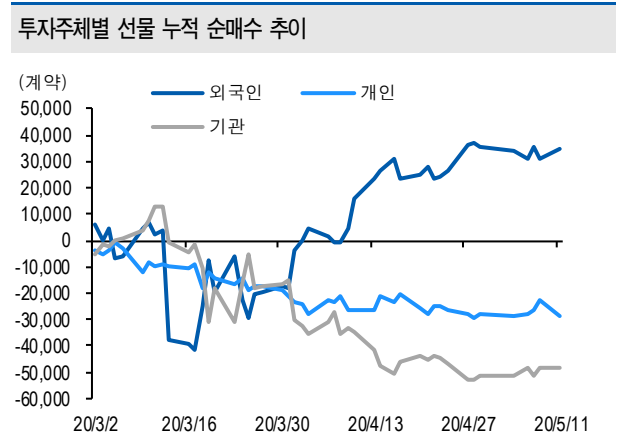


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-170.2	11.6	-158.6	-40.7	-4.1	378.5	-130.1	-3.1	-2.6	2.3	
개인	512.2	18.2	530.4	0.0	-0.1	-363.2	8.5	3.5	2.2	-19.4	
기관	-364.1	-34.3	-398.4	-43.5	-100.5	-33.8	121.5	-0.3	0.5	16.5	
금융투자	-151.7	-16.4	-168.1	0.0	-12.1	130.5	122.9	0.3	0.2	-14.4	
투신	-35.6	-2.7	-38.3	0.0	-18.0	-277.6	-1.5	-0.6	0.0	1.0	
은행+보험+기타금융	-76.8	-8.2	-85.0	0.0	-72.4	14.9	0.0	0.0	0.3	-1.9	
연기금+국가자자채	-73.3	-3.5	-76.9	-43.5	3.1	98.5	0.0	0.0	0.0	31.8	
기타법인	22.1	4.5	26.6	0.0	-0.1	18.5	0.1	-0.2	-0.1	0.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





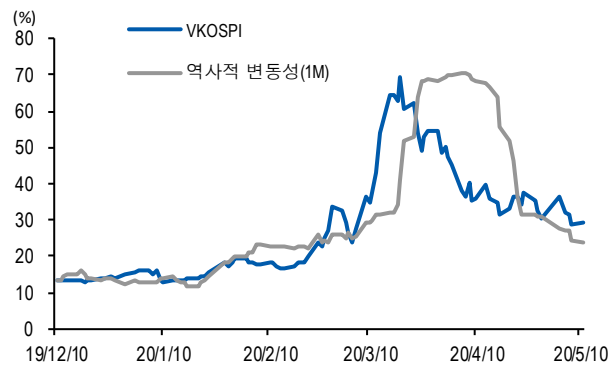
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	1,131,356	226.8	973,699	22.4%	지수옵션 전체	2,330,872	501.1	2,359,899		
Put	1,199,516	274.3	1,386,200	29.4%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	29.33%(+0.56%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	265.0(K+3)	0.11	-0.40	188,296	42,473	6,150	21.7	Put	260.0(K+1)	6.04	0.99	7,903	6,455	758	26.6
	262.5(K+2)	0.31	-0.66	169,161	19,387	5,259	22.3		257.5(K+0)	4.29	0.61	57,584	5,158	1,033	26.7
	260.0(K+1)	0.71	-1.03	174,129	23,042	3,257	22.7		255.0(K-1)	2.94	0.26	117,109	11,441	2,981	27.5
	257.5(K+0)	1.46	-1.40	97,116	13,060	1,472	23.6		252.5(K-2)	2.01	0.06	105,573	10,850	2,430	29.2
	255.0(K-1)	2.64	-1.72	27,624	10,466	834	24.9		250.0(K-3)	1.34	-0.09	137,592	17,580	3,386	30.7

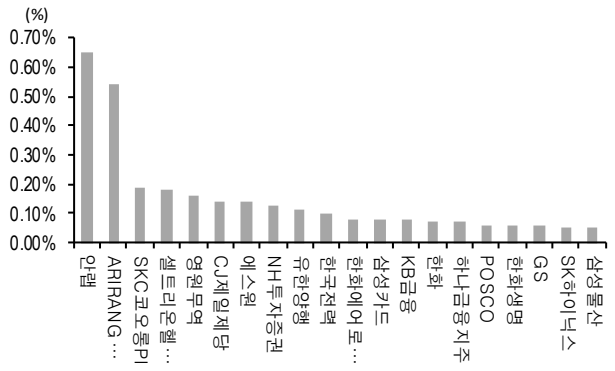
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,856,780	1,751.0	5,155,684	162,111	8,122	-41,051	30,737	2.3	-19.4	16.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	24,600	-1.40	5.0	64.7	24,794	-2,588	-0.12%	893	-1,418	521	-71	585
대림산업	80,800	-0.37	11.5	61.1	5,214	-3,973	-0.10%	522	-2,703	2,181	841	1,340
카카오	207,500	0.97	129.1	59.0	37,945	-3,091	-0.05%	763	-201	-525	-754	319
현대차	93,200	-1.48	92.3	57.9	63,752	-11,387	-0.04%	-5,287	-7,051	11,905	4,127	6,016
엔씨소프트	698,000	3.10	51.8	56.8	2,124	-190	0.01%	-140	128	13	55	-165
SK 하이닉스	84,700	-0.47	132.8	56.3	239,946	-10,400	0.05%	-596	-5,270	6,250	1,887	1,332
삼성전자	48,400	-0.92	371.9	47.8	1,250,662	-211,067	0.04%	26,947	-195	-26,620	-42,216	12,210
기아차	30,550	-0.65	36.3	47.3	71,695	-880	-0.03%	-11,630	3,023	8,597	5,189	-2,557
삼성 SDI	287,000	0.35	46.1	43.1	9,337	-731	-0.15%	-2,317	9	2,029	-434	2,564
삼성전기	116,000	-2.11	25.9	40.5	54,094	-2,868	0.02%	-72	76	56	47	740

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터