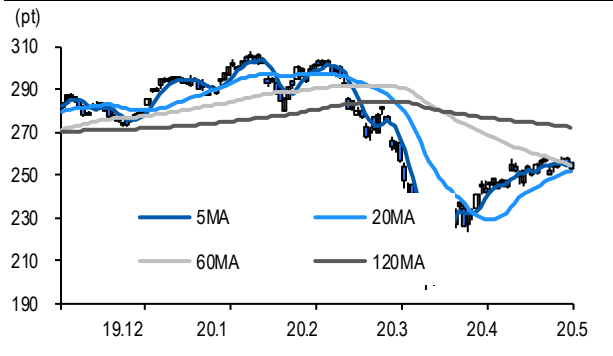


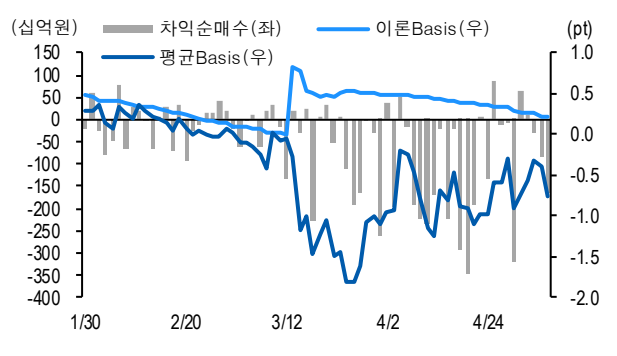


선물옵션시장 지표 2020.5.13

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	253.37	-0.62	-1.58	6,397.4	-
선물 6월물	252.80	-0.57	-1.45	19,659.9	351,506
선물 9월물	251.80	-0.69	-1.75	10.0	10,620
5월물(mini)	253.20	-0.60	-1.54	1,261.5	68,655
6월물(mini)	252.76	-0.59	-1.62	177.7	68,205

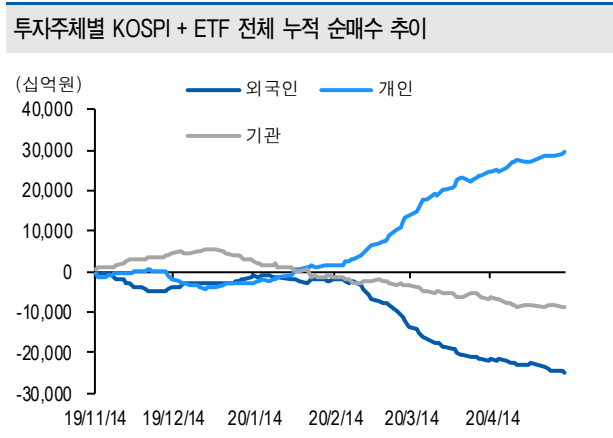


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.22	-0.76	-0.57	-0.39%	
베이스스(mini)	0.01	-0.28	-0.17	-0.12%	
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.65	-0.70	-0.19%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.19	-0.19	-0.08%	

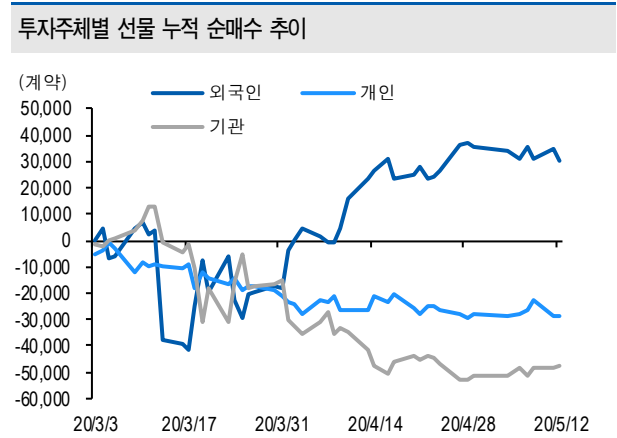


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-310.5	31.7	-278.8	-62.6	-145.4	-108.7	-194.3	-4.6	-7.0	-27.0	
개인	606.2	-29.0	577.1	0.0	0.3	-2.3	0.8	1.8	2.0	-35.9	
기관	-299.0	-1.2	-300.2	-99.4	-9.0	56.0	193.1	2.6	4.7	63.5	
금융투자	-293.1	-26.6	-319.6	-27.2	-30.1	162.1	194.8	3.4	4.3	8.4	
투신	58.2	6.1	64.4	0.0	36.4	-192.4	-1.6	-1.0	0.3	19.6	
은행+보험+기타금융	13.8	1.2	15.1	0.0	-5.8	18.6	0.0	0.2	0.1	-1.0	
연기금+국가자차체	-74.2	4.7	-69.5	-72.2	-2.1	67.6	0.0	0.0	0.0	36.5	
기타법인	3.4	-1.5	1.9	0.0	0.1	55.0	0.3	0.1	0.4	-0.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





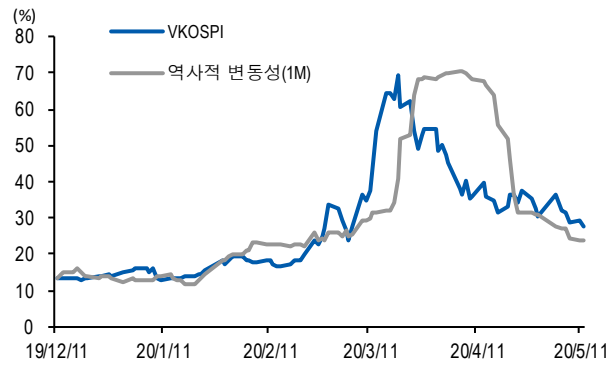
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,539,158	266.2	1,019,476	22.9%	지수옵션 전체	3,135,561	672.9	2,450,669
Put	1,596,403	406.7	1,431,193	29.8%	PCR(금액기준)	1.53	VKOSPI	27.79%(-1.54%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	262.5(K+3)	0.08	-0.23	274,928	33,652	14,265	22.0	Put	257.5(K+1)	4.97	0.68	14,373	4,594	-564	25.7
	260.0(K+2)	0.25	-0.46	281,203	28,112	5,070	22.3		255.0(K+0)	3.32	0.38	67,912	11,885	444	26.5
	257.5(K+1)	0.66	-0.80	245,896	18,010	4,950	22.8		252.5(K-1)	2.10	0.09	135,766	12,008	1,158	27.6
	255.0(K+0)	1.50	-1.14	209,595	14,880	4,414	24.1		250.0(K-2)	1.30	-0.04	232,831	19,913	2,333	29.2
	252.5(K-1)	2.79	-1.39	78,520	10,612	3,862	25.3		247.5(K-3)	0.78	-0.12	192,322	12,498	1,394	30.8

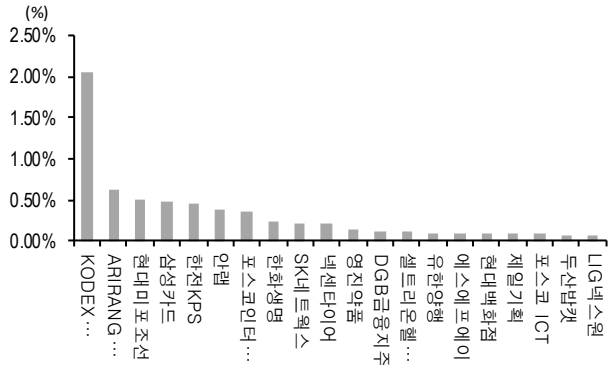
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,938,766	2,448.2	5,128,248	-27,436	-40,406	-75,995	116,691	-27.0	-35.9	63.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	23,550	-4.27	11.2	92.5	29,677	4,883	-0.60%	2,928	6,551	-9,513	-10,209	1,312
SK 하이닉스	86,000	1.53	192.5	63.5	260,101	20,155	0.05%	-2,995	-8,084	11,448	-645	-11,877
카카오	215,000	3.61	207.0	62.6	35,124	-2,821	-0.05%	-1,100	6,452	-5,440	-3,232	-1,814
삼성전자	47,950	-0.93	581.4	55.0	891,106	-359,556	0.01%	-6,096	-82,760	89,624	12,079	82,292
호텔신라	80,400	1.13	23.5	53.5	20,064	-353	-0.41%	-600	-152	760	-180	451
삼성전기	118,500	2.16	41.5	45.2	53,079	-1,015	-0.11%	328	-1,840	1,521	470	747
삼성 SDI	283,000	-1.39	52.2	44.5	6,547	-2,790	-0.27%	-761	-1,113	1,977	385	1,601
LG 이노텍	142,000	4.41	21.7	40.9	13,821	56	-0.07%	545	-656	109	184	-983
현대차	92,000	-1.29	47.0	40.7	55,443	-8,309	-0.13%	-2,015	-4,014	6,482	1,877	4,641
신세계	243,000	-0.21	9.4	39.9	992	-468	-0.23%	177	-37	-141	-262	35

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터