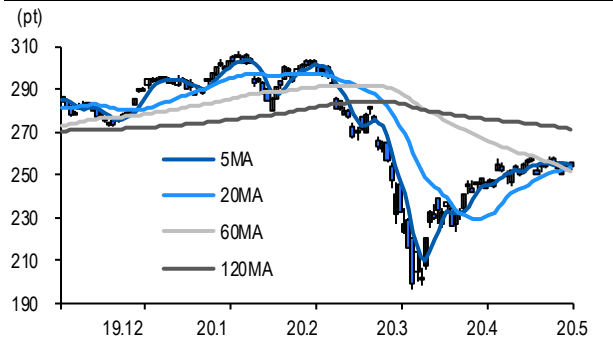
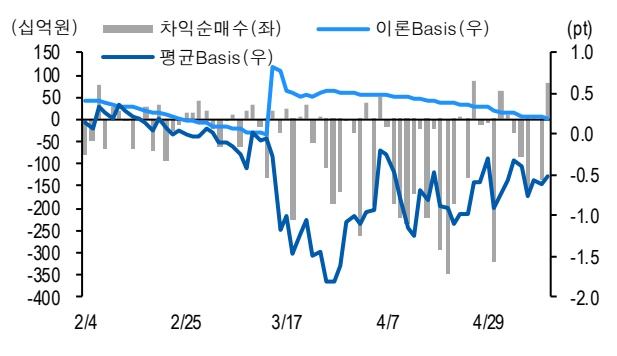


선물옵션시장 지표 2020.5.18

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	253.79	0.06	0.14	6,425.2	-	
선물 6월물	253.60	0.50	1.25	20,343.3	354,107	
선물 9월물	252.95	0.52	1.30	13.6	12,399	
6월물(mini)	253.52	0.46	1.16	1,424.9	100,568	
7월물(mini)	252.78	0.33	0.82	8.8	419	

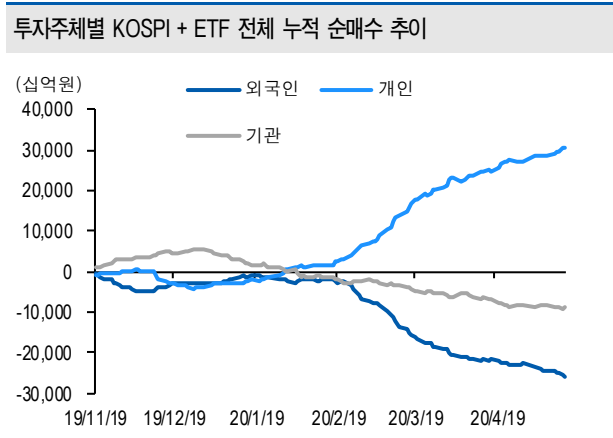


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.20	-0.52	-0.19	-0.28%	
베이스(mini)	0.20	-0.52	-0.27	-0.28%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.70	-0.70	-0.21%	
합성선물 베이스(ATM)	0.20	-0.19	-0.19	-0.15%	

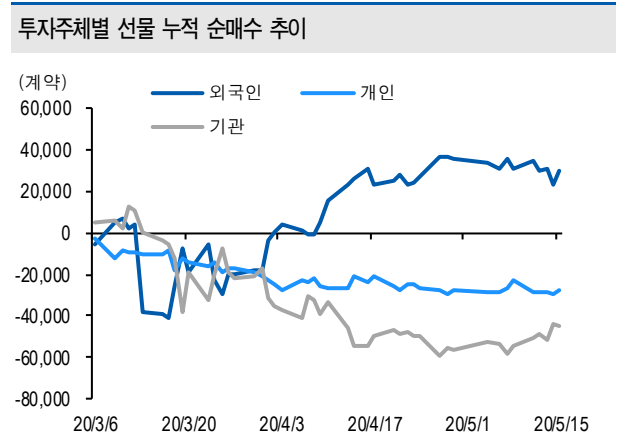


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-472.7	27.2	-445.5	-0.2	-451.0	233.8	-74.2	-2.5	-1.8	12.8	
개인	223.9	-121.5	102.4	0.0	-1.1	122.9	0.4	1.4	-1.5	63.1	
기관	241.4	100.0	341.4	85.0	-4.7	-224.5	73.5	0.8	2.8	-76.7	
금융투자	41.3	84.6	125.9	-10.1	12.5	-398.1	73.2	4.1	5.4	4.0	
투신	0.4	8.1	8.5	0.0	-4.3	313.2	0.4	-3.2	-2.6	1.8	
은행+보험+기타금융	0.8	7.5	8.3	0.0	-17.5	-32.7	0.0	0.0	0.0	1.8	
연기금+국가자자체	213.6	-0.4	213.2	95.1	6.8	-107.0	0.0	0.0	0.0	-84.3	
기타법인	7.4	-5.6	1.8	0.0	-0.1	-132.2	0.3	0.3	0.6	0.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	476,064	180.8	625,041	20.5%	지수옵션 전체	1,069,100	435.2	1,466,952
Put	593,036	254.4	841,911	26.0%	PCR(금액기준)	1.41	VKOSPI	26.96%(+0.17%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	260.0(K+3)	3.28	0.41	37,727	12,376	2,042	20.4	Put	255.0(K+1)	7.03	-0.61	6,236	5,512	925	23.2
	257.5(K+2)	4.38	0.49	13,575	5,202	1,072	21.1		252.5(K+0)	6.00	-0.46	10,687	4,539	2,508	24.0
	255.0(K+1)	5.64	0.60	14,265	11,475	4,169	21.8		250.0(K-1)	5.11	-0.42	12,745	9,866	-407	24.9
	252.5(K+0)	7.10	0.80	5,071	3,672	949	22.6		247.5(K-2)	4.35	-0.35	10,120	2,321	558	25.8
	250.0(K-1)	8.71	0.71	1,286	8,507	266	23.4		245.0(K-3)	3.72	-0.34	19,351	10,395	700	26.7

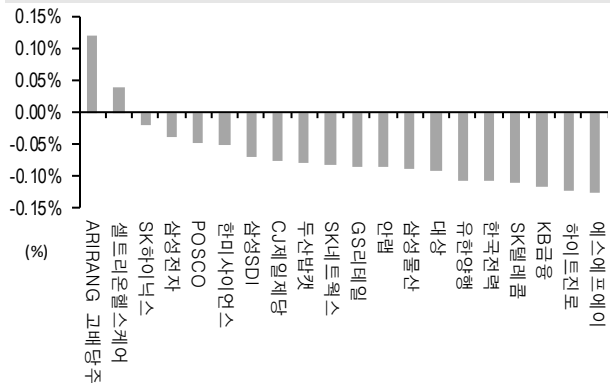
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,253,919	2,011.9	4,075,162	324,724	18,794	111,474	-134,227	12.8	63.1	-76.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	145,500	1.04	19.6	77.0	15,747	2,467	-0.18%	681	406	-1,087	114	-2,689
카카오	221,500	-1.56	237.1	70.2	42,010	1,209	-0.24%	-2,225	-957	3,337	2,796	634
삼성전기	119,500	0.00	41.0	65.2	36,595	3,057	-0.19%	888	-425	-473	130	-2,537
삼성전자	47,850	0.10	517.7	60.4	1,461,560	88,409	-0.04%	18,515	74,386	-92,993	9,023	-102,540
LG 전자	54,200	0.18	15.4	56.7	32,678	-2,491	-0.32%	412	-4,699	4,287	650	3,388
삼성 SDI	302,000	-2.11	78.2	55.8	13,889	1,809	-0.07%	242	-144	-158	353	-1,160
SK 하이닉스	81,800	0.74	184.5	54.4	205,905	17,484	-0.02%	696	16,236	-17,261	-6,386	-11,548
엔씨소프트	743,000	-0.67	39.5	53.3	2,535	253	-0.22%	-251	18	234	310	-60
대림산업	80,000	2.17	7.7	50.6	9,521	1,778	-0.13%	75	1,445	-1,511	-585	-916
호텔신라	79,800	0.00	11.9	47.6	11,736	-168	-0.34%	-701	-202	901	587	721

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터