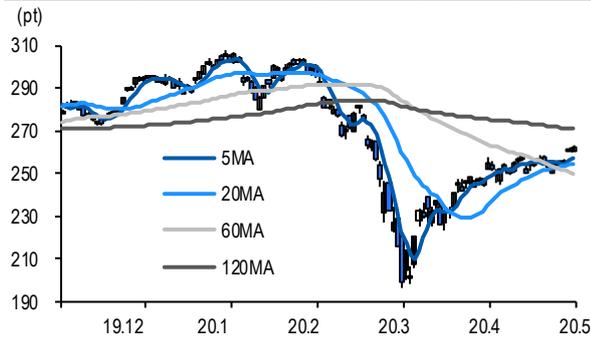


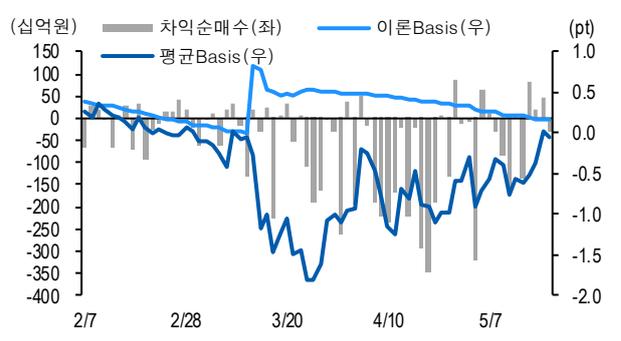
선물옵션시장 지표

2020.5.21

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	262.72	0.36	0.93	5,118.3	-	
선물 6월물	262.15	0.08	0.20	14,453.4	348,177	
선물 9월물	261.60	0.11	0.30	39.4	12,732	
6월물(mini)	262.30	0.13	0.36	1,249.0	109,899	
7월물(mini)	261.46	0.15	0.40	2.9	4,549	

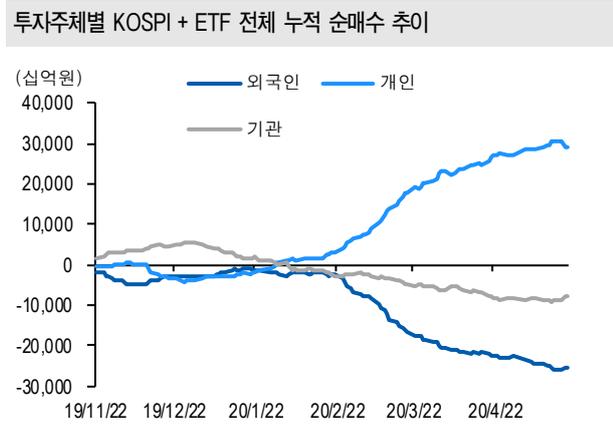


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.16	-0.05	-0.57	-0.08%	
베이스(mini)	0.16	-0.05	-0.42	-0.08%	
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.65	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.16	-0.51	-0.51	-0.26%	

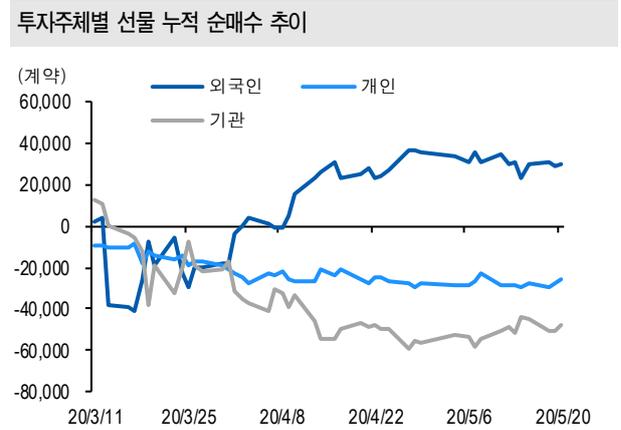


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	79.9	16.2	96.1	5.7	-106.0	27.7	-15.4	-0.7	-1.3	8.5	
개인	-181.1	-26.0	-207.1	0.0	-0.8	156.3	-3.8	0.9	0.0	42.7	
기관	96.4	13.8	110.2	-35.5	5.0	-183.4	19.2	-0.2	1.4	-51.9	
금융투자	-7.8	11.0	3.1	0.0	3.5	-48.1	18.8	-1.1	2.0	-19.7	
투신	21.1	16.0	37.1	0.0	-8.2	-165.8	0.3	-0.1	0.0	4.6	
은행+보험+기타금융	4.9	-10.7	-5.8	0.0	4.8	-4.0	0.0	1.0	-0.6	0.0	
연기금+국가자자체	53.5	0.3	53.8	-35.5	3.6	34.5	0.0	0.0	0.0	-36.8	
기타법인	4.8	-4.0	0.8	0.0	-0.1	-0.6	0.0	0.0	-0.1	0.7	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	482,744	180.6	714,132	19.5%	지수옵션 전체	869,365	317.4	1,710,632
Put	386,621	136.7	996,500	24.6%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	24.85%(-0.15%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	270.0(K+3)	2.39	0.11	72,327	29,461	1,336	19.5	Put	265.0(K+1)	7.09	-0.14	1,127	4,195	121	22.6
	267.5(K+2)	3.24	0.14	33,570	13,844	1,049	19.7		262.5(K+0)	5.85	-0.18	4,550	1,809	839	23.0
	265.0(K+1)	4.29	0.14	20,306	14,666	39	20.0		260.0(K-1)	4.83	-0.16	8,642	11,754	1,148	23.6
	262.5(K+0)	5.56	0.07	8,407	8,585	-71	20.4		257.5(K-2)	3.99	-0.16	9,108	3,209	1,076	24.3
	260.0(K-1)	7.04	0.10	3,491	14,509	137	20.9		255.0(K-3)	3.30	-0.11	15,872	6,650	-280	25.1

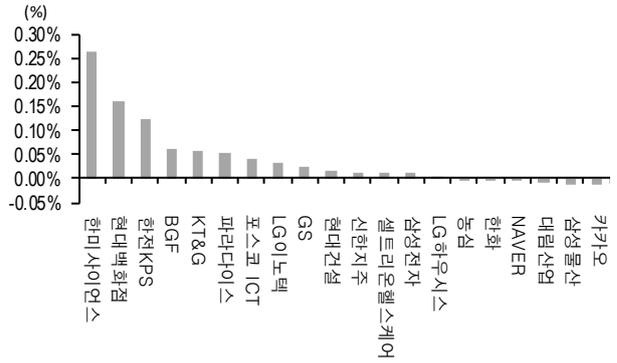
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,043,153	1,583.2	4,476,684	50,060	-8,909	35,097	-26,428	8.5	42.7	-51.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	232,000	5.45	261.9	65.0	48,140	7,649	-0.01%	1,274	2,754	-4,029	1,910	-6,412
삼성 SDI	331,000	4.09	128.1	64.4	18,545	3,436	-0.01%	1,067	87	-1,221	155	-2,899
기아차	30,950	-2.83	35.2	57.9	57,676	-4,573	-0.06%	-5,604	-3,048	8,681	6,819	2,788
SK 하이닉스	84,000	1.33	163.1	55.4	181,335	-7,185	-0.03%	-3,955	146	3,664	2,756	5,640
NAVER	222,000	4.23	100.5	47.9	33,887	8,070	-0.01%	2,593	5,926	-8,511	-2,056	-7,456
삼성전기	124,000	0.81	24.0	47.0	30,129	1,024	-0.40%	1,222	144	-1,370	321	-1,325
LG 전자	57,800	-1.20	14.8	46.9	36,658	-473	-0.17%	-1,114	-1,483	2,497	1,747	1,038
대림산업	82,000	0.49	6.4	46.4	13,136	2,278	-0.01%	-214	2,101	-1,889	-1,220	-670
LG 이노텍	142,000	1.79	14.0	46.1	18,653	2,529	0.03%	354	18	-372	26	-1,394
현대차	97,300	-2.31	81.3	46.1	94,817	-5,260	-0.03%	-2,600	-4,275	7,072	933	6,027

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터