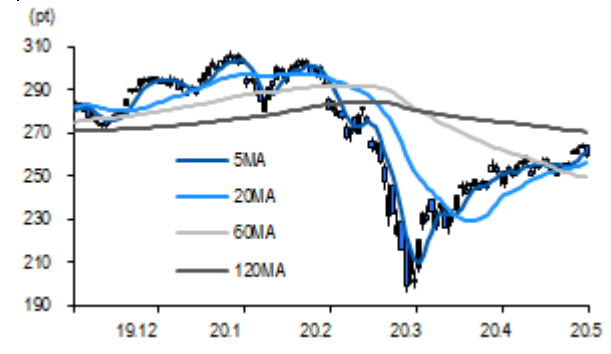




선물옵션시장 지표 2020.5.25

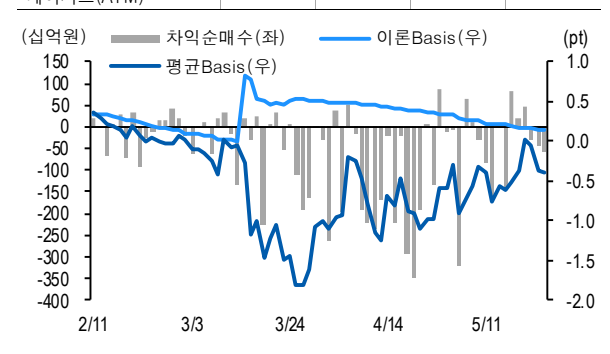
Market Data (십억원, 계약)

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	259.62	-1.56	-4.12	5,781.4	-
선물 6월물	258.80	-1.80	-4.75	19,090.6	352,491
선물 9월물	258.20	-1.77	-4.65	80.1	15,287
6월물(mini)	258.80	-1.81	-4.70	1,643.7	116,487
7월물(mini)	257.94	-1.77	-4.64	5.5	8,994



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.15	-0.40	-0.82	-0.21%
베이스스(mini)	0.15	-0.40	-0.82	-0.21%
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.62	-0.60	-0.17%
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	-0.84	-0.84	-0.38%

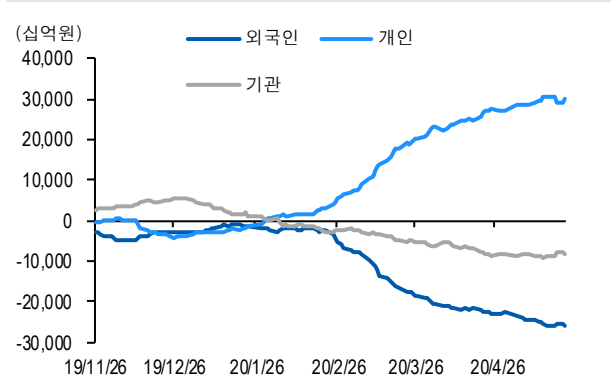


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-467.9	-6.0	-473.9	-0.9	-210.9	-22.6	-90.6	-0.1	0.6	19.7
개인	939.5	-3.0	936.5	0.0	-0.4	-60.1	5.5	-1.0	1.5	-36.4
기관	-456.2	7.5	-448.6	-54.6	-89.1	112.7	84.5	1.5	-2.3	20.4
금융투자	-259.0	-7.3	-266.3	-19.5	-28.6	428.1	85.5	1.4	-2.3	22.7
투신	-41.2	5.2	-36.0	0.0	-21.6	-431.2	-1.0	0.0	0.0	-44.1
은행+보험+기타금융	-23.8	12.1	-11.7	-0.3	-13.6	80.5	0.0	0.0	0.1	0.8
연기금+국가자재	-76.3	0.1	-76.2	-34.8	-10.7	35.3	0.1	0.0	0.0	41.0
기타법인	-15.5	1.5	-14.0	0.0	-0.4	-30.0	0.6	-0.3	0.1	-3.7

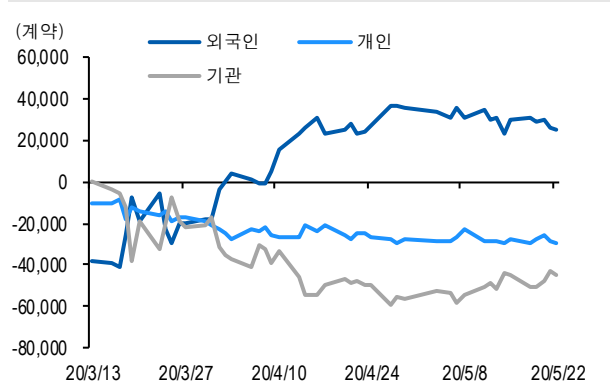
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이





선물옵션시장 지표

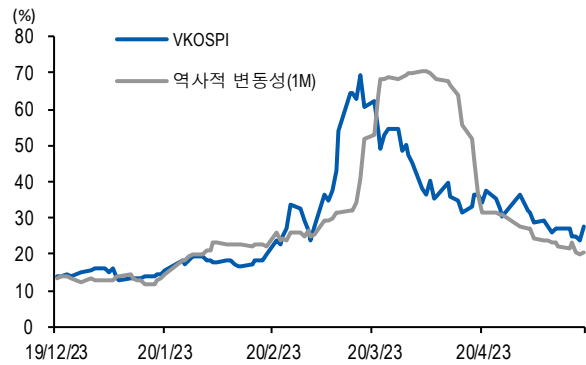
지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	725,074	205.1	758,704	18.8%	지수옵션 전체	1,792,349	588.6	1,844,036
Put	1,067,275	383.6	1,085,332	26.2%	PCR(금액기준)	1.87	VKOSPI	27.74%(+4.17%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	270.0(K+3)	1.27	-1.09	89,197	27,802	1,073	18.6	Put	265.0(K+1)	8.93	2.97	4,870	4,577	-169	23.7
	267.5(K+2)	1.88	-1.42	55,182	14,619	813	19.0		262.5(K+0)	7.50	2.64	10,253	4,195	933	24.2
	265.0(K+1)	2.71	-1.77	41,069	16,686	2,142	19.5		260.0(K-1)	6.31	2.35	17,729	12,024	-336	24.9
	262.5(K+0)	3.78	-2.12	18,659	9,322	745	20.1		257.5(K-2)	5.28	2.05	18,278	4,508	749	25.7
	260.0(K-1)	5.07	-2.41	9,534	14,321	472	20.9		255.0(K-3)	4.42	1.77	37,810	8,735	845	26.5

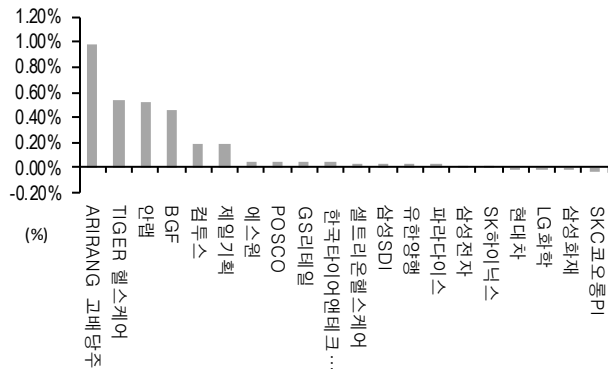
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	2,874,406	2,116.4	4,430,100	-103,425	33,771	-58,082	28,096	19.7	-36.4	20.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	136,500	-2.50	21.5	83.5	12,330	-5,044	-0.38%	-43	-161	205	839	2,766
삼성 SDI	335,500	0.30	123.8	79.6	20,154	2,061	0.03%	-9	-870	949	1,296	-1,253
카카오	246,000	3.80	358.1	77.8	45,645	-3,416	-0.22%	842	-2,602	1,851	-2,357	7,285
삼성전기	116,000	-4.92	51.7	63.3	25,469	-5,766	-0.82%	2,278	-101	-2,211	726	3,905
현대차	94,300	-2.78	92.9	60.2	93,036	-5,291	0.00%	1,887	-149	-1,644	2,246	216
LG 화학	377,000	-0.26	112.3	59.1	17,564	2,868	-0.01%	-388	-899	1,395	661	-1,852
삼성전자	48,700	-2.60	549.2	58.0	1,539,232	-49,579	0.01%	59,618	-30,201	-25,994	-8,554	14,692
SK 하이닉스	81,400	-2.63	159.6	56.7	177,407	-1,425	0.00%	-81	1,760	-1,670	4,569	-4,421
기아차	30,050	-1.48	27.2	51.1	51,216	-17,639	-0.11%	409	-236	-173	1,963	5,416
GS 건설	24,050	-2.63	3.9	47.8	41,312	299	-0.15%	938	-545	-395	-2,050	2,619

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터