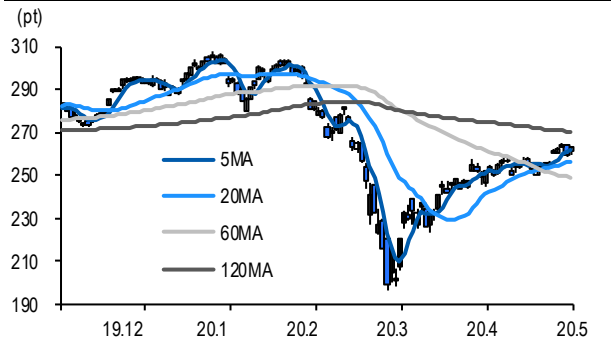
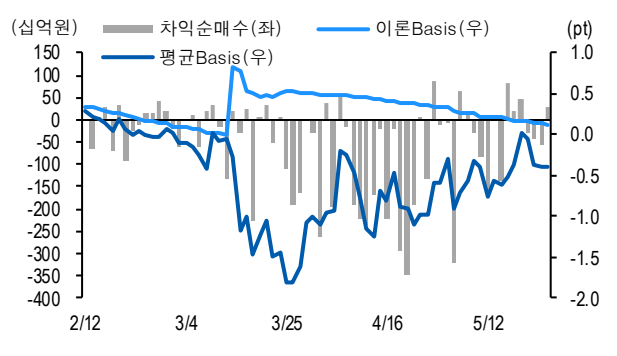


선물옵션시장 지표 2020.5.26

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	262.76	1.21	3.14	5,207.5	-	
선물 6월물	263.00	1.62	4.20	14,437.1	348,069	
선물 9월물	262.20	1.55	4.00	56.8	16,870	
6월물(mini)	262.60	1.47	3.80	1,126.4	122,130	
7월물(mini)	261.82	1.50	3.88	3.2	8,988	

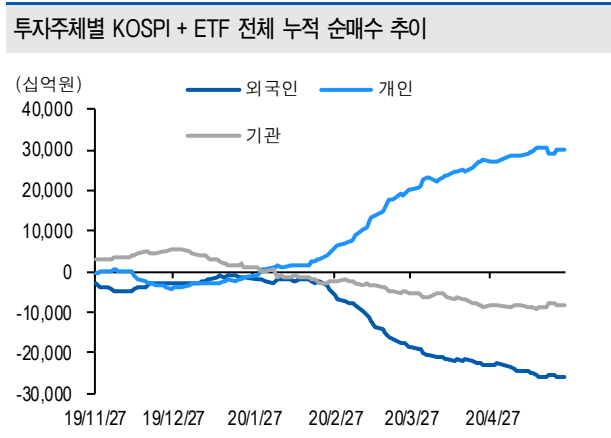


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.12	-0.40	0.24	-0.20%	
베이스(mini)	0.12	-0.40	-0.16	-0.20%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.65	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.12	0.19	0.19	0.02%	

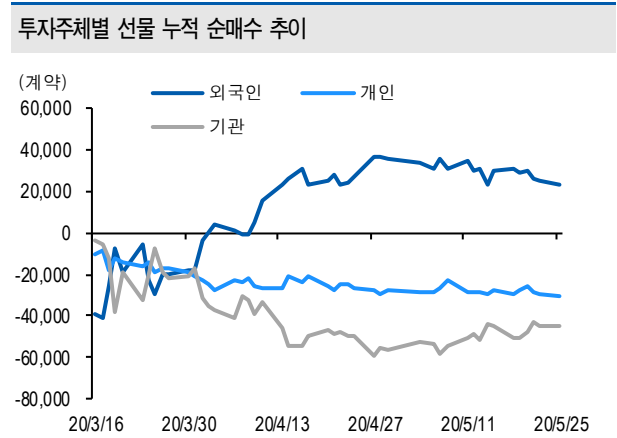


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-142.1	17.3	-124.8	-3.2	-69.5	1.8	-73.8	-1.3	-2.3	24.0	
개인	96.0	-60.6	35.4	0.0	-0.4	-33.9	-9.5	2.4	0.4	0.0	
기관	35.1	35.3	70.4	33.3	-15.4	-19.1	82.9	-1.2	2.1	-25.0	
금융투자	2.8	84.9	87.7	-9.1	-4.4	-419.0	82.6	-0.8	2.1	7.9	
투신	50.1	-6.3	43.9	0.0	20.0	442.9	0.2	-0.1	0.1	9.4	
은행+보험+기타금융	-47.1	13.5	-33.6	0.6	-8.7	4.8	0.1	-0.4	0.0	-0.6	
연기금+국가자자체	59.7	2.4	62.2	41.9	-0.5	-47.8	0.0	0.0	0.0	-41.7	
기타법인	11.1	8.0	19.1	0.0	0.0	51.1	0.4	0.1	-0.2	0.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





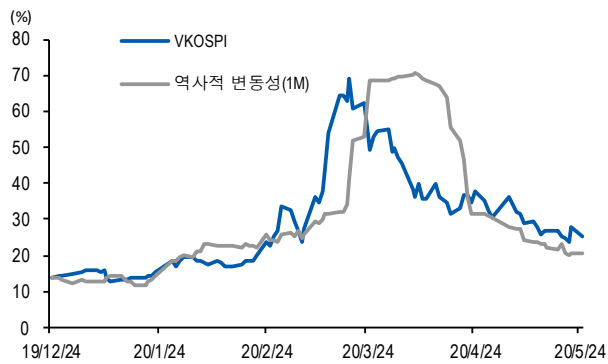
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	703,712	207.7	783,778	20.2%	지수옵션 전체	1,380,227	428.3	1,896,464
Put	676,515	220.5	1,112,686	25.3%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	25.27%(-2.47%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	267.5(K+3)	2.73	0.85	64,151	16,837	2,218	19.9	Put	262.5(K+1)	4.83	-2.67	3,433	4,100	-95	21.6
	265.0(K+2)	3.87	1.16	46,661	17,559	873	20.8		260.0(K+0)	3.91	-2.40	13,095	11,588	-436	22.6
	262.5(K+1)	5.23	1.45	15,934	9,333	11	21.6		257.5(K-1)	3.17	-2.11	14,216	5,290	782	23.6
	260.0(K+0)	6.86	1.79	9,768	14,208	-113	22.9		255.0(K-2)	2.59	-1.83	22,585	9,230	495	24.8
	257.5(K-1)	8.61	2.08	2,881	6,070	77	23.9		252.5(K-3)	2.13	-1.60	22,159	8,143	988	26.0

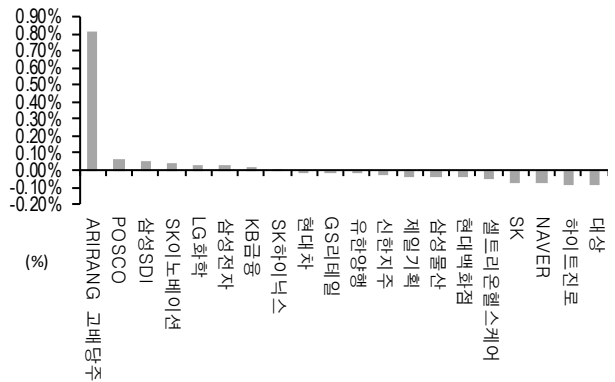
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,336,183	1,949.0	4,526,741	96,641	42,298	17,869	-61,907	24.0	0.0	-25.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	349,000	4.02	182.2	81.2	25,826	5,672	0.05%	322	1,272	-1,643	2,095	-6,230
LG 화학	390,500	3.58	132.3	68.5	19,842	2,278	0.03%	27	940	-970	673	-1,952
SK 하이닉스	81,500	0.12	142.6	62.1	174,551	-2,856	0.01%	-689	-2,268	2,957	1,739	2,188
삼성전자	48,900	0.41	417.8	61.3	1,576,953	37,721	0.03%	37,400	2,823	-41,007	-12,257	-27,590
카카오	266,000	8.13	414.0	60.2	48,340	2,695	-0.71%	609	-5,123	4,570	502	6,632
기아차	30,450	1.33	19.1	56.3	47,582	-3,634	-0.14%	-2,098	-316	2,411	2,703	-620
현대차	95,900	1.70	61.1	54.5	93,324	288	0.00%	-1,112	776	349	127	710
NAVER	240,500	4.11	118.4	49.3	34,306	246	-0.08%	480	-1,563	1,017	134	676
엔씨소프트	812,000	3.57	40.6	48.6	2,479	-100	-0.24%	61	-100	43	-79	89
대림산업	79,900	1.52	4.5	43.7	11,378	-312	-0.16%	-590	-6	594	1,084	10

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터