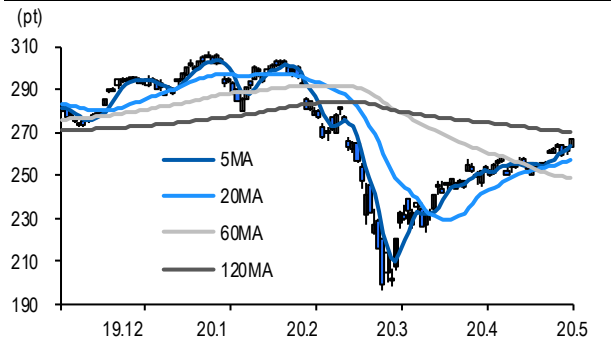


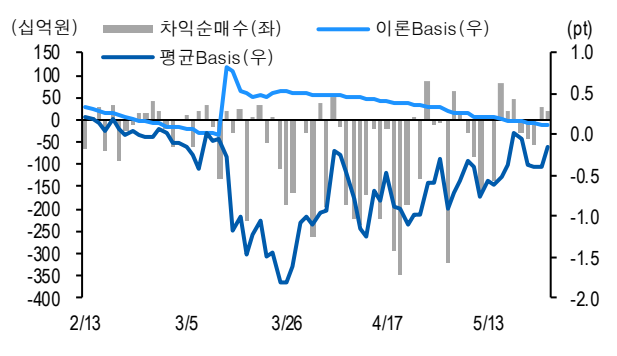


선물옵션시장 지표 2020.5.27

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	267.31	1.73	4.55	7,582.8	-
선물 6월물	266.65	1.39	3.65	16,871.3	345,935
선물 9월물	266.10	1.49	3.90	98.1	17,720
6월물(mini)	266.70	1.41	4.10	1,471.3	121,659
7월물(mini)	266.06	1.62	4.24	2.2	9,025

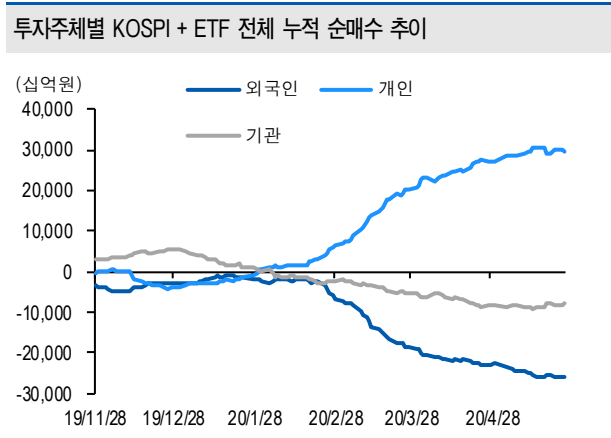


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.12	-0.14	-0.66	-0.10%	
베이스스(mini)	0.12	-0.14	-0.61	-0.10%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.65	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	-0.61	-0.61	-0.27%	

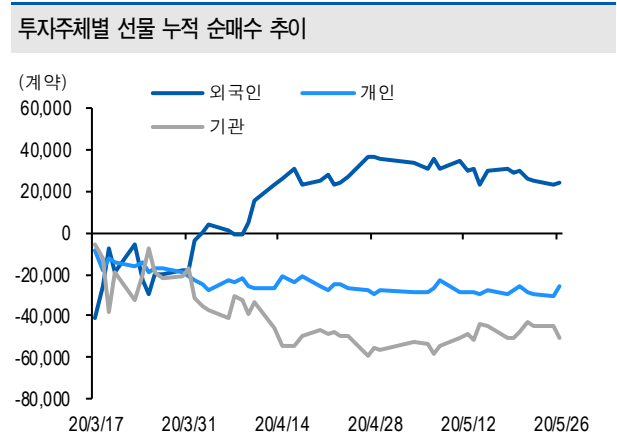


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	9.0	22.2	31.2	0.0	-74.7	-91.4	122.7	6.4	-2.9	5.3	
개인	-480.5	-51.4	-532.0	0.0	1.1	306.3	-1.4	-2.6	-0.3	22.7	
기관	341.7	32.5	374.2	21.1	2.7	-160.9	-120.9	-3.1	4.2	-28.8	
금융투자	266.1	79.9	345.9	-1.3	5.3	-447.7	-121.5	-2.8	3.2	-19.1	
투신	10.4	-26.8	-16.4	0.0	-10.1	256.7	0.6	-0.1	0.1	39.5	
은행+보험+기타금융	-23.2	-13.6	-36.8	0.0	-7.7	56.8	0.0	-0.1	0.9	2.3	
연기금+국가자자체	96.7	-13.5	83.3	22.4	10.3	-26.8	-0.1	0.0	0.0	-51.5	
기타법인	129.8	-3.3	126.5	0.0	0.1	-54.0	-0.4	-0.7	-1.0	0.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





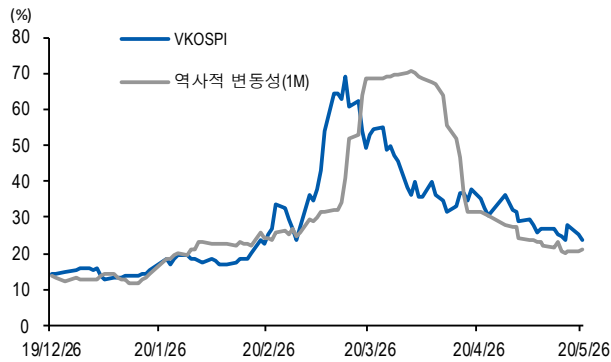
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	936,454	342.7	792,113	18.3%	지수옵션 전체	1,636,032	536.6	1,953,215
Put	699,578	193.9	1,161,102	25.3%	PCR(금액기준)	0.57	VKOSPI	23.80%(-1.47%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	270.0(K+3)	3.05	1.14	129,110	30,205	-4,598	18.2	Put	265.0(K+1)	4.01	-1.96	13,851	7,586	2,931	22.4
	267.5(K+2)	4.25	1.52	52,060	17,708	871	18.6		262.5(K+0)	3.20	-1.63	22,083	5,163	1,063	23.3
	265.0(K+1)	5.72	1.85	27,917	17,591	32	19.2		260.0(K-1)	2.57	-1.34	31,421	12,989	1,401	24.3
	262.5(K+0)	7.40	2.17	6,275	8,775	-558	19.8		257.5(K-2)	2.07	-1.10	30,354	8,315	3,025	25.3
	260.0(K-1)	9.27	2.41	4,650	14,642	434	20.4		255.0(K-3)	1.67	-0.92	42,202	12,686	3,456	26.4

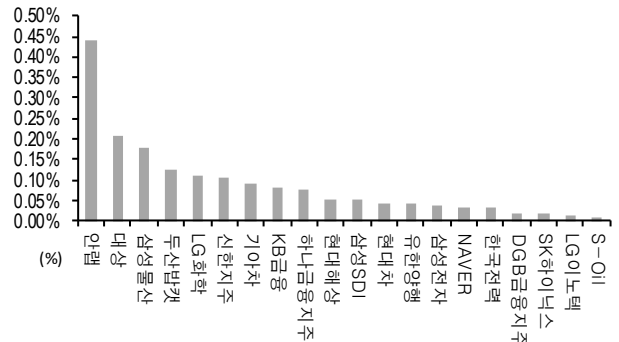
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,224,898	2,691.8	4,711,841	185,100	16,554	40,417	-58,904	5.3	22.7	-28.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	389,000	11.46	393.6	72.9	29,272	3,446	0.05%	-927	-1,524	2,271	1,046	-217
엔씨소프트	800,000	-1.48	57.9	63.5	2,696	217	-0.19%	-31	111	-51	120	-119
삼성전자	49,350	0.92	470.3	63.4	1,618,634	41,681	0.04%	19,583	14,989	-36,191	-19,757	-15,708
현대차	98,400	2.61	119.6	61.0	100,723	7,399	0.04%	-597	740	-151	498	-4,205
SK 하이닉스	81,900	0.49	141.0	57.2	172,674	-1,877	0.02%	2,383	-43	-2,382	-2,189	2,998
LG 화학	416,000	6.53	212.6	54.5	24,532	4,690	0.11%	178	-321	79	-1,064	-1,960
GS 건설	27,050	12.47	41.9	53.8	61,538	20,105	-0.01%	-14,557	2,638	11,942	10,905	-4,432
NAVER	239,000	-0.62	195.8	53.0	36,561	2,255	0.03%	153	1,033	-1,042	339	-2,901
카카오	269,500	1.32	364.7	41.9	54,719	6,379	-0.81%	-1,625	-2,097	3,839	1,033	1,563
기아차	31,800	4.43	34.2	41.8	66,570	18,988	0.09%	285	-1,183	924	-8,391	-2,663

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

