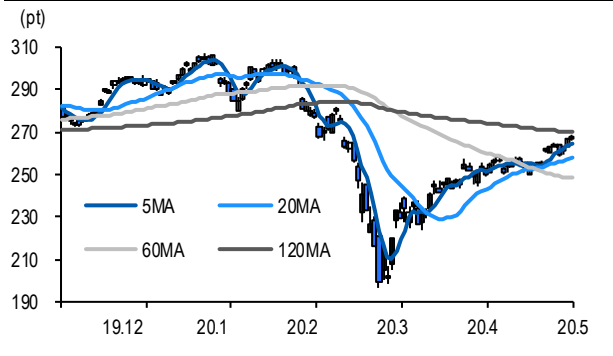
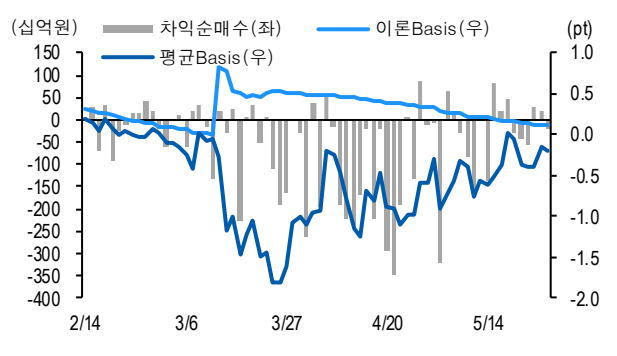


선물옵션시장 지표 2020.5.28

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	267.64	0.12	0.33	7,993.1	-
선물 6월물	267.10	0.17	0.45	18,934.7	346,666
선물 9월물	266.60	0.19	0.50	135.3	17,704
6월물(mini)	267.08	0.16	0.38	1,388.5	124,100
7월물(mini)	266.62	0.21	0.56	3.6	9,050

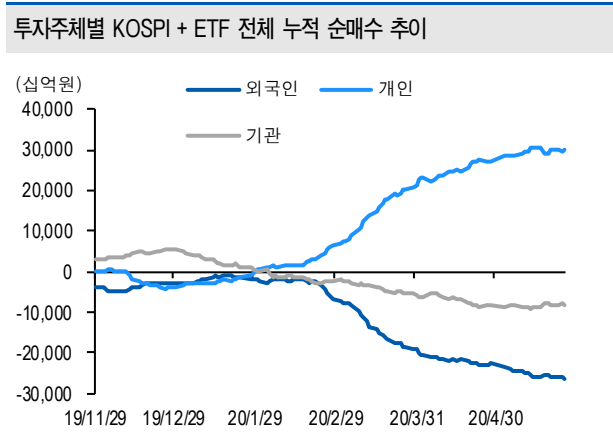


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.11	-0.21	-0.54	-0.12%	
베이스(mini)	0.11	-0.20	-0.56	-0.12%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.65	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.11	-0.47	-0.47	-0.22%	

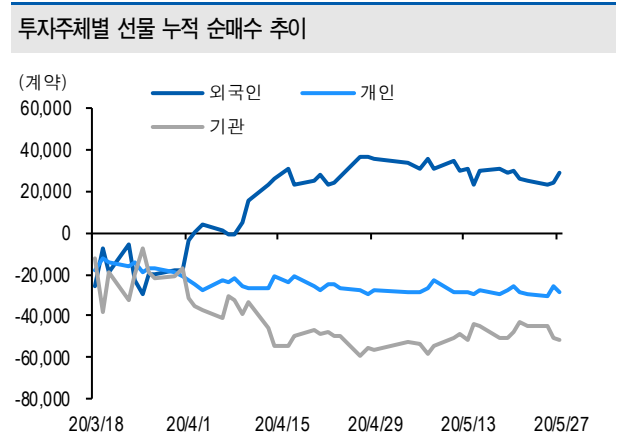


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-215.7	-6.5	-222.2	0.0	-150.7	313.3	-17.7	-0.9	-4.3	-12.1
개인	320.8	53.8	374.6	0.0	-2.0	-217.4	-7.7	1.6	1.2	11.6
기관	-86.4	-47.8	-134.2	-20.8	-48.4	-201.7	25.3	-0.4	3.5	-1.5
금융투자	-79.6	2.6	-77.0	-16.0	-13.5	143.9	24.8	-0.4	3.4	-11.4
투신	-1.8	-15.4	-17.2	0.0	-21.8	-343.8	0.6	0.0	0.1	11.2
은행+보험+기타금융	-0.9	-7.1	-8.1	0.0	-7.2	-5.7	-0.1	0.0	0.0	-0.6
연기금+국가자자체	2.3	-11.1	-8.8	-4.8	6.1	3.9	0.0	0.0	0.0	-0.6
기타법인	-18.6	0.5	-18.2	0.0	0.0	105.8	0.0	-0.3	-0.4	2.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	933,591	306.5	817,706	18.5%	Option total	1,622,256	525.2	2,031,600		
Put	688,665	218.8	1,213,894	24.5%	PCR(Val. base)	0.71	VKOSPI	24.47%(+0.67%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	275.0(K+3)	1.48	0.08	147,754	24,309	-818	18.2	Put	270.0(K+1)	6.12	-0.23	3,268	9,249	312	21.9
	272.5(K+2)	2.28	0.17	98,446	17,233	1,391	18.8		267.5(K+0)	4.87	-0.20	14,698	4,246	2,986	22.4
	270.0(K+1)	3.26	0.21	86,226	33,095	2,890	19.1		265.0(K-1)	3.88	-0.13	22,636	8,568	982	23.1
	267.5(K+0)	4.54	0.29	20,880	18,033	325	19.7		262.5(K-2)	3.10	-0.10	30,548	6,528	1,365	24.0
	265.0(K-1)	6.05	0.33	7,459	16,982	-609	20.4		260.0(K-3)	2.49	-0.08	52,900	16,097	3,108	25.1

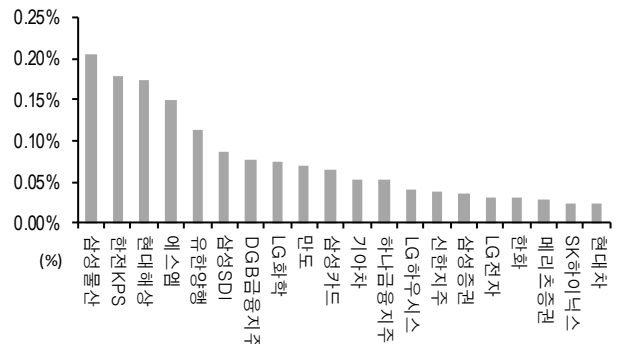
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,893,221	2,628.8	4,844,254	132,413	-17,361	17,062	-2,087	-12.1	11.6	-1.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	396,500	-4.69	177.3	71.1	23,371	-1,161	0.07%	-520	-405	993	-1,145	1,870
SK 하이닉스	81,500	-0.49	142.8	59.5	173,620	946	0.02%	4,185	1,246	-5,437	349	-6,410
삼성전자	49,900	1.11	570.4	59.2	1,627,726	9,092	0.02%	-14,950	28,372	-16,354	-28,453	20,360
삼성 SDI	365,500	-6.04	361.3	58.0	32,107	2,835	0.09%	-714	784	-66	-803	22
LG 전자	59,800	4.18	57.8	57.5	46,330	9,578	0.03%	-708	10,782	-10,244	-4,956	-5,422
현대차	98,000	-0.41	90.4	56.8	102,240	1,517	0.02%	2,226	607	-2,909	-1,140	-2,601
카카오	260,500	-3.34	276.6	52.5	49,725	-4,994	-0.48%	414	942	-1,412	376	-1,446
삼성전기	121,500	-1.62	37.7	49.8	31,499	373	-0.09%	779	-713	-67	-1,283	681
엔씨소프트	784,000	-2.00	33.1	45.0	2,768	72	-0.10%	161	18	-182	-8	-61
LG 이노텍	140,000	-1.41	12.4	44.1	15,447	2,192	0.01%	-963	49	910	880	-1,124

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터