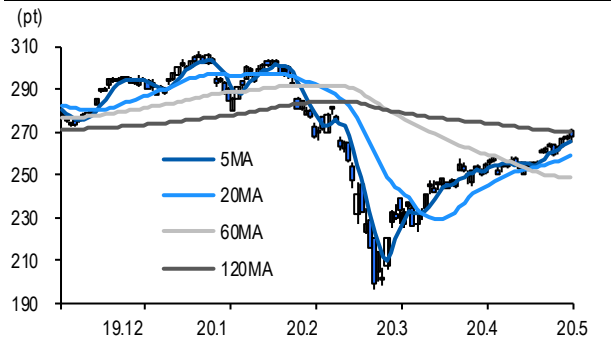
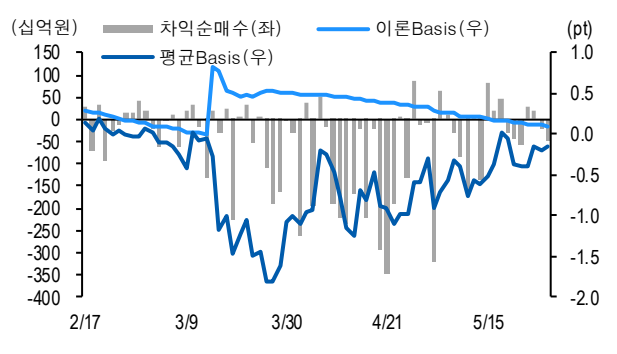


선물옵션시장 지표 2020.5.29

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	268.29	0.24	0.65	9,595.6	-	
선물 6월물	268.30	0.45	1.20	25,540.4	342,880	
선물 9월물	267.70	0.41	1.10	144.0	18,049	
6월물(mini)	268.26	0.43	1.18	2,188.1	121,645	
7월물(mini)	267.32	0.26	0.70	8.4	9,059	

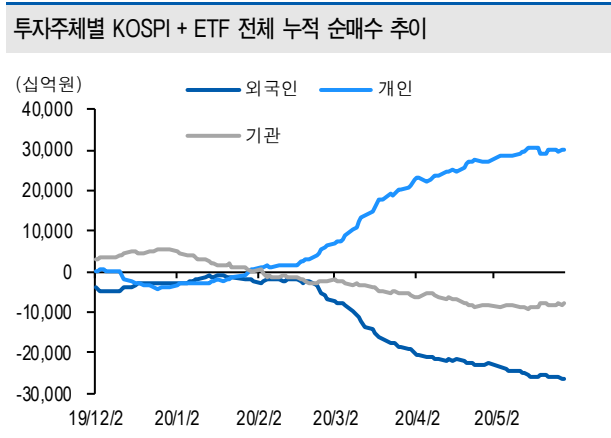


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.08	-0.16	0.01	-0.09%	
베이스(mini)	0.08	-0.16	-0.03	-0.09%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.61	-0.60	-0.17%	
합성선물 베이스(ATM)	0.08	-0.02	-0.02	-0.04%	

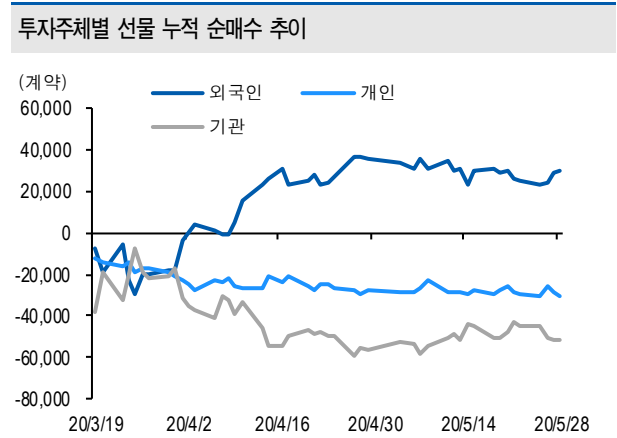


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	43.3	-1.4	41.9	0.0	-73.5	-5.8	70.8	4.4	-1.8	-32.9	
개인	-283.3	57.1	-226.2	0.0	0.3	-88.6	0.5	-1.5	0.2	57.7	
기관	239.3	-69.1	170.1	-47.0	-32.4	109.7	-71.9	-2.5	1.9	-25.7	
금융투자	120.0	-38.8	81.2	-37.8	-9.3	192.5	-72.2	-2.1	1.6	-45.3	
투신	8.9	-14.6	-5.7	0.0	-8.9	-67.4	0.4	-0.4	0.1	25.9	
은행+보험+기타금융	31.5	-27.7	3.8	0.0	9.4	-14.6	0.0	0.0	0.2	0.3	
연기금+국가자자체	98.7	-8.9	89.8	-9.2	-7.8	-0.8	-0.1	0.0	0.0	-6.6	
기타법인	0.8	13.4	14.2	0.0	-0.4	-15.3	0.5	-0.4	-0.2	0.9	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





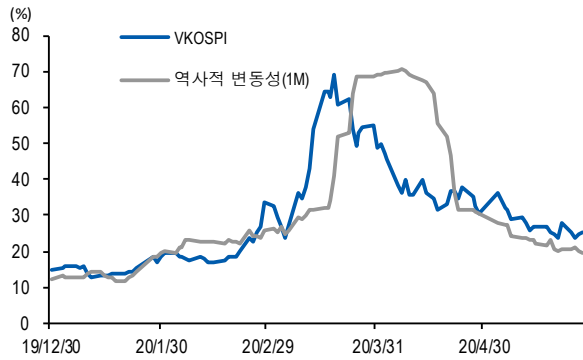
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,263,455	408.0	837,441	20.3%	지수옵션 전체	2,331,724	767.0	2,132,066
Put	1,068,269	359.0	1,294,625	24.9%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	25.24%(+0.77%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	275.0(K+3)	1.86	0.38	158,809	24,907	598	20.0	Put	270.0(K+1)	5.58	-0.54	14,680	10,494	1,245	21.8
	272.5(K+2)	2.73	0.45	87,573	19,344	2,111	20.5		267.5(K+0)	4.45	-0.42	30,094	5,877	1,631	22.6
	270.0(K+1)	3.85	0.59	65,516	29,156	-3,939	21.2		265.0(K-1)	3.56	-0.32	54,466	10,259	1,691	23.6
	267.5(K+0)	5.22	0.68	19,736	17,344	-689	22.0		262.5(K-2)	2.87	-0.23	66,793	9,239	2,711	24.7
	265.0(K-1)	6.84	0.79	10,733	16,472	-510	23.0		260.0(K-3)	2.31	-0.18	76,200	19,286	3,189	25.9

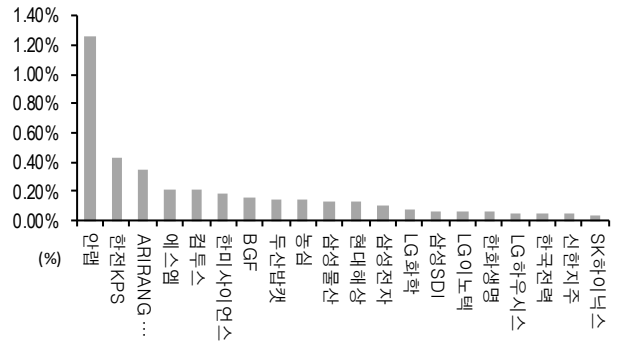
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,116,681	3,654.3	4,895,636	51,382	-61,171	55,173	7,611	-32.9	57.7	-25.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	58,700	-1.84	48.6	76.0	40,091	-6,239	0.03%	-3,555	-2,982	6,519	328	5,720
현대차	97,300	-0.71	114.4	73.2	94,006	-8,234	0.00%	-1,491	-1,308	2,869	-1,160	5,654
LG 화학	389,500	-1.77	235.8	71.7	22,542	-829	0.07%	389	340	-763	-1,361	277
삼성 SDI	359,000	-1.78	366.2	69.6	32,569	462	0.07%	561	549	-1,527	-2,260	1,339
대림산업	85,900	-0.46	29.8	65.0	11,702	-1,428	-0.05%	-1,168	-1,875	3,144	471	1,444
S-Oil	71,000	-1.11	28.3	63.1	19,775	-2,046	-0.12%	1,177	176	-1,364	426	1,245
GS 건설	27,700	-1.25	20.8	60.5	49,597	-8,169	-0.57%	-4,880	4,033	848	1,289	6,034
카카오	266,000	2.11	392.9	60.3	45,230	-4,495	-0.27%	1,542	2,113	-3,700	-750	-1,240
SK 하이닉스	83,800	2.82	435.6	56.3	239,218	65,598	0.04%	-6,770	27,267	-20,854	-25,573	-15,430
삼성전기	122,500	0.82	88.1	52.6	36,475	4,976	-0.08%	459	2,468	-2,943	-1,134	-3,634

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터