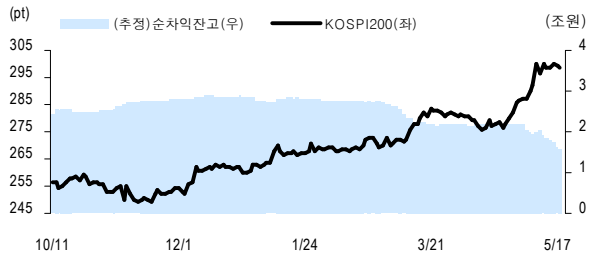
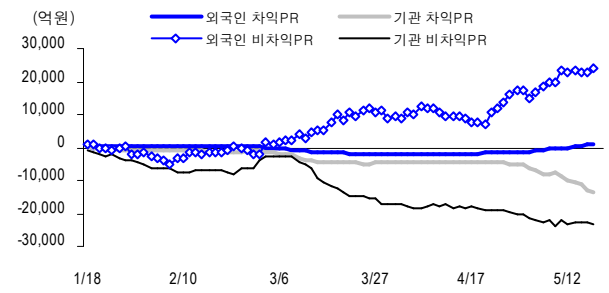


선물옵션시장 지표 2017.5.19

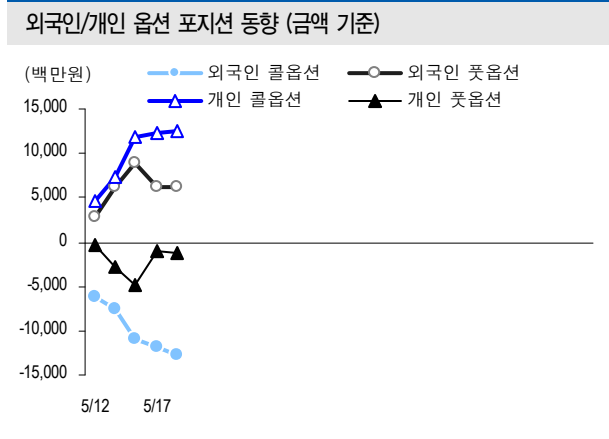
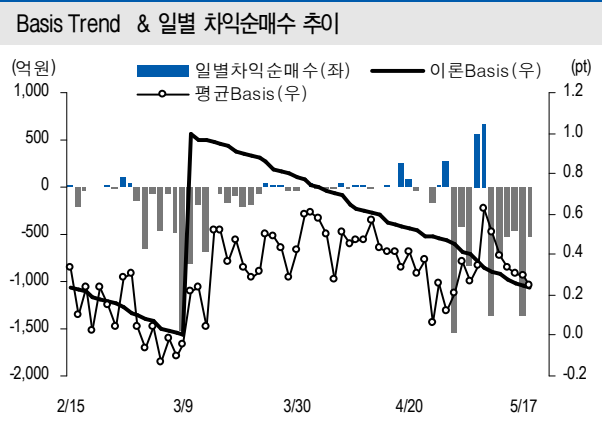
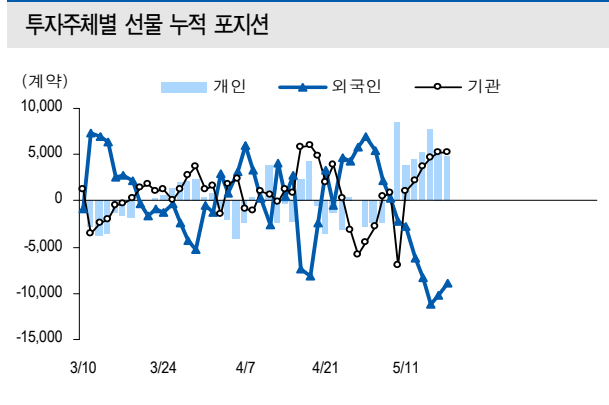
Market Data				
	선물6월물	선물9월물	KOSPI200	KOSPI
전일대비	-0.85	-0.80	-0.87	-6.26
전일비	-0.28%	-0.27%	-0.29%	-0.27%
종가	298.75	299.55	298.47	2,286.82
거래량	207,089	1,200	거래량(천주)	374,307
미결제약정	276,084	39,176	거래대금(억원)	58,309



프로그램 매매 동향 / 주체별 PR 추이 (단위: 억원)			
시장 Basis	0.28	차익순매수	-514
평균 Basis	0.25	비차익순매수	390
이론 Basis	0.25	제1스프레드(SP)	1
이론가과리율(%)	0.01	SP 거래량	325
Mini K200 시장 Basis	0.33	Mini K200 평균 Basis	0.25



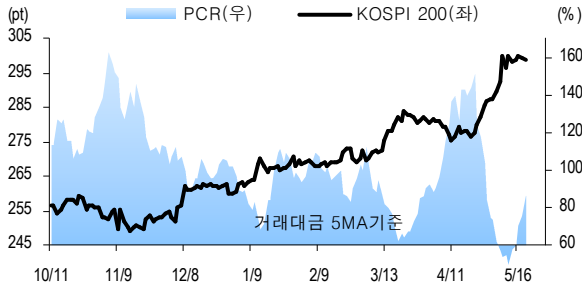
투자주체별 매매동향			
	외국인	개인	기관
현물(억원)	238	-190	-608
선물(계약)	1,390	-730	91
선물 누적	-8,819	4,930	5,226
콜옵션(계약)	3,057	4,488	-741
콜옵션 누적	29,089	2,760	-20,696
풋옵션(계약)	36,579	-35,764	4,643
풋옵션 누적	189,914	-139,480	-27,984



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

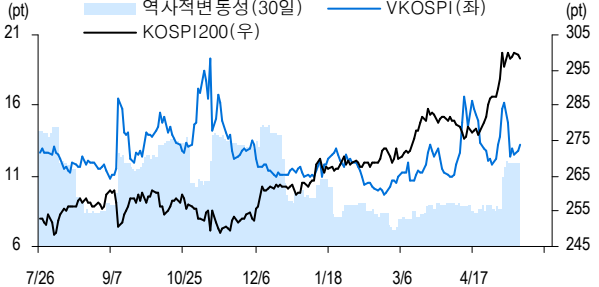
선물옵션시장 지표

Put Call Ratio



	PCR	전일대비	5MA
거래량 기준	107.06	6.67	96.49
거래대금 기준	107.06	10.41	87.19

Historical Volatility (30일) & VKOSPI



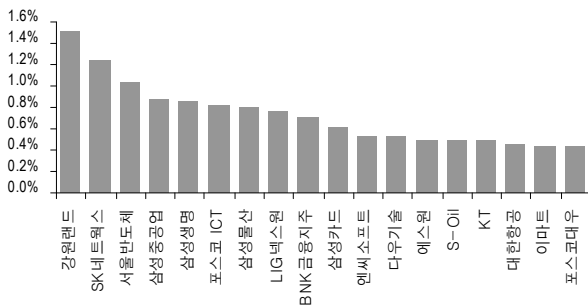
	VKOSPI	H.V	대표 Call I.V	대표 Put I.V
전일	13.18	11.89	11.50	12.50
증감	0.35	-0.03	0.10	0.40

주식선물시장 동향 (거래량 상위 10종목)

종목	기초자산			주식선물						거래대금 비율 선물/현물(%)
	가격	등락률	거래대금	가격	등락률	거래대금	거래량	미결제약정	베이스스	
SK 하이닉스	55,700	1.83	190,488	55,500	1.09	53,141	97,361	102,827	-200	27.90
미래에셋대우	9,500	-0.42	32,981	9,500	-0.73	8,361	89,092	151,979	0	25.35
두산인프라코어	9,150	0.33	27,754	9,160	0.11	7,339	81,938	50,109	10	26.44
LG 유플러스	14,600	5.8	52,452	14,500	5.07	7,232	50,886	27,405	-100	13.79
기아차	38,200	2.83	96,128	38,100	2.56	18,127	47,851	88,704	-100	18.86
신한지주	48,700	-0.81	53,546	48,850	-0.51	16,432	33,859	22,221	150	30.69
LG 디스플레이	29,500	1.37	69,938	29,550	1.55	8,997	30,582	44,043	50	12.86
KB 금융	52,900	-0.94	60,993	53,000	-0.75	14,516	27,573	56,946	100	23.80
LG 전자	79,100	-1.13	56,726	79,200	-1	21,484	27,108	36,391	100	37.87
대한항공	32,700	-0.15	24,069	32,850	0.15	5,468	16,661	38,180	150	22.72
			665,074			161,096	502,911	618,805		24.22

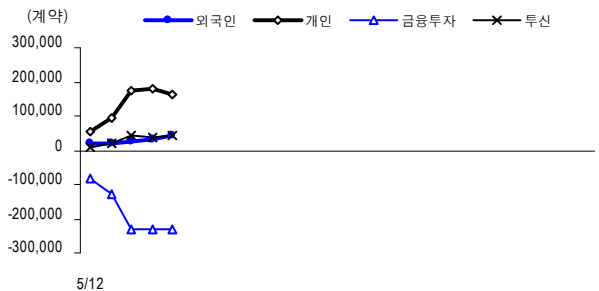
단위: 가격(원), 거래대금(백만원), 베이스스(원) / 등락률 (%) / 거래량, 미결제약정 (계약)

주식선물 베이스스 괴리율



주: 베이스스 괴리율 = 베이스스 / 현물 증가

투자주체별 주식선물 누적 포지션



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터