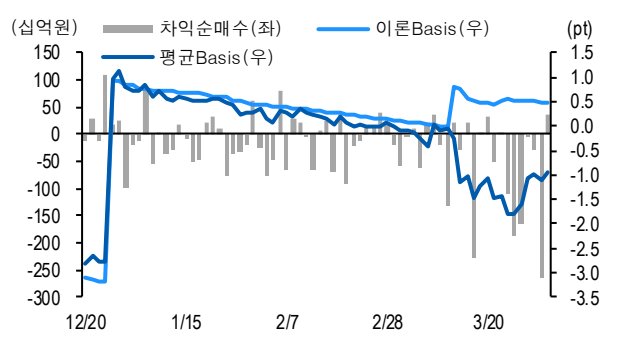
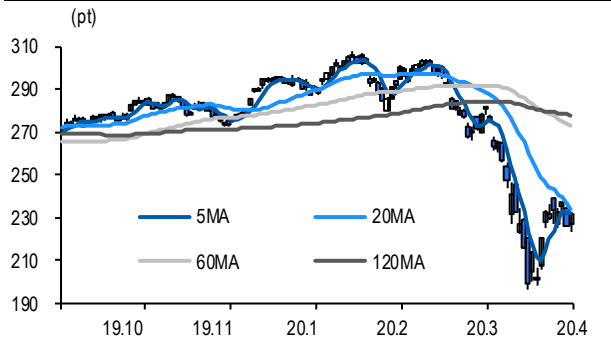




선물옵션시장 지표 2020.4.3

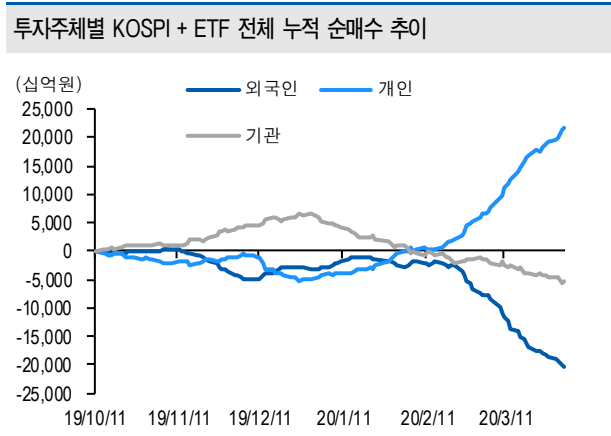
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	231.84	2.43	5.49	6,992.0	-
선물 6월물	231.65	2.89	6.50	30,303.2	339,777
선물 9월물	230.65	2.81	6.30	12.0	5,206
4월물(mini)	232.10	2.87	6.48	1,708.9	147,565
5월물(mini)	231.64	2.76	6.22	22.3	7,231

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.49	-0.96	-0.19	-0.63%	
베이스(mini)	0.05	-0.47	0.26	-0.22%	
제1스프레드(SP)	-0.21	-0.55	-0.55	-0.15%	
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.24	0.24	0.08%	

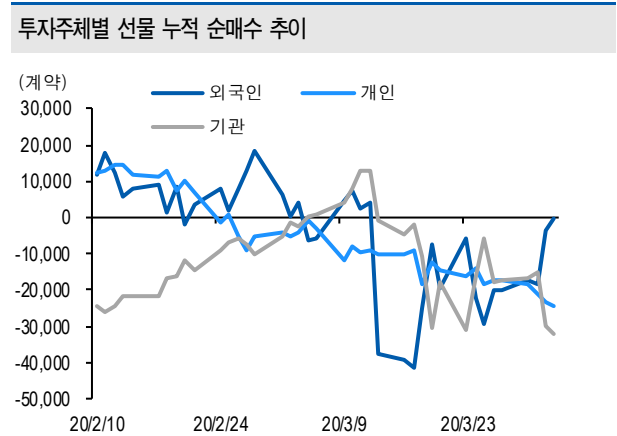


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-576.1	0.1	-576.0	-61.1	-227.5	186.8	11.3	-2.4	2.8	34.5	
개인	274.8	91.2	366.0	0.0	-1.0	-64.3	-5.6	-0.2	4.6	-9.5	
기관	312.6	-94.4	218.2	97.3	-25.1	-116.0	-4.7	2.4	-7.7	-26.2	
금융투자	85.9	-110.4	-24.5	-28.3	-24.9	-122.3	-4.6	2.9	-8.0	17.3	
투신	39.9	18.2	58.2	0.0	5.6	111.8	-0.1	-0.5	-0.3	-9.7	
은행+보험+기타금융	27.5	11.2	38.6	0.0	-1.5	20.5	0.0	0.0	0.5	0.9	
연기금+국가자재	166.7	-16.4	150.3	127.9	-2.3	-125.9	0.0	0.0	0.0	-34.7	
기타법인	-11.3	3.0	-8.3	0.0	-0.1	-6.5	-1.0	0.2	0.3	1.1	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





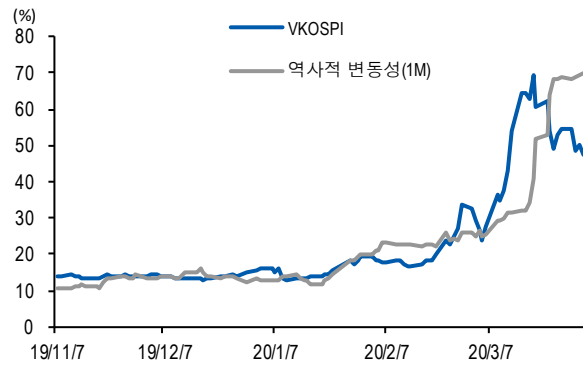
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,076,673	331.0	1,256,539	45.7%	지수옵션 전체	2,196,051	749.7	2,328,326
Put	1,119,378	418.7	1,071,787	53.3%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	47.24%(-2.76%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	235.0(K+3)	4.80	1.72	63,794	9,791	1,004	45.2	Put	230.0(K+1)	5.64	-3.86	5,261	13,953	-302	48.0
	232.5(K+2)	6.24	2.19	13,911	7,873	-842	47.7		227.5(K+0)	4.77	-3.51	7,509	15,007	392	49.7
	230.0(K+1)	7.70	2.51	13,856	14,653	-461	49.2		225.0(K-1)	4.03	-3.22	12,635	7,486	435	51.5
	227.5(K+0)	9.35	2.88	6,984	5,409	165	51.1		222.5(K-2)	3.40	-2.90	8,694	10,660	122	53.2
	225.0(K-1)	11.05	3.14	3,526	6,295	799	52.5		220.0(K-3)	2.87	-2.68	21,988	11,647	-10	55.0

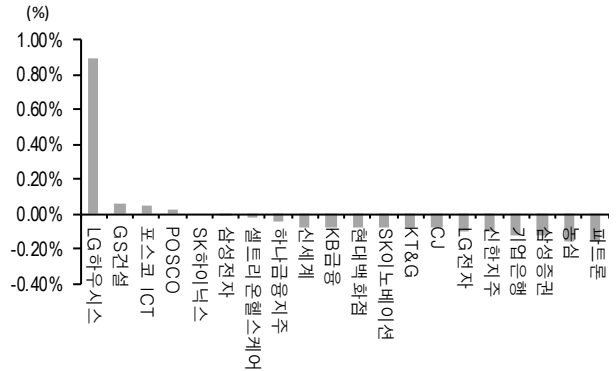
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,458,183	2,582.9	5,130,038	51,842	66,724	16,480	-84,398	34.5	-9.5	-26.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	80,300	1.77	343.2	81.2	251,475	-7,308	0.00%	4,955	-9,873	4,739	1,051	11,015
호텔신라	67,800	1.19	34.8	68.7	26,789	622	-0.20%	1,007	601	-1,688	465	-1,753
삼성전자	46,850	2.07	652.4	65.9	1,918,138	-17,844	-0.01%	32,961	1,268	-34,597	36,732	-41,041
현대백화점	57,400	2.50	3.7	65.8	7,131	2,523	-0.08%	-518	2,655	-2,137	-1,491	-646
하나금융지주	22,600	3.67	28.6	63.4	138,042	8,122	-0.04%	-5,052	6,242	-952	-486	-2,892
KB 금융	31,800	1.11	45.8	61.9	97,605	3,533	-0.08%	3,179	4,731	-8,064	-5,458	-1,689
GS 건설	20,100	5.24	9.8	60.2	36,628	2,359	0.05%	-395	3,970	-3,596	494	-4,099
삼성전기	96,300	2.67	35.2	59.2	32,703	1,833	-0.50%	-1,021	664	352	-31	1,060
현대건설	27,300	5.41	19.3	57.6	7,219	442	-0.25%	1,363	311	-1,690	-136	-1,541
LG 이노텍	113,000	5.61	21.8	53.0	8,776	631	-0.50%	523	-269	-254	441	-266

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터