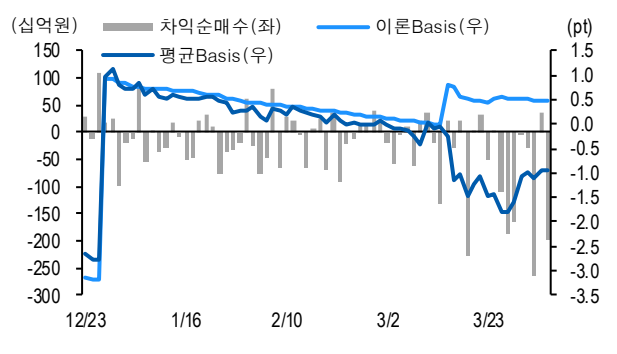
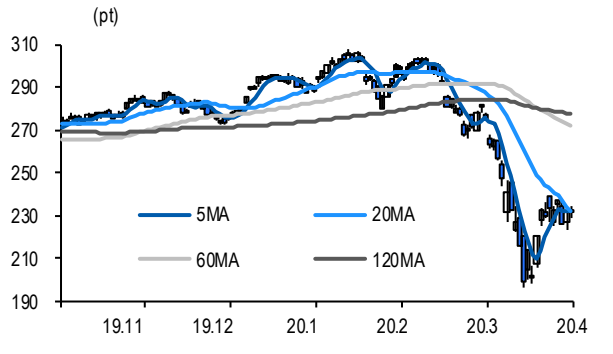




선물옵션시장 지표 2020.4.6

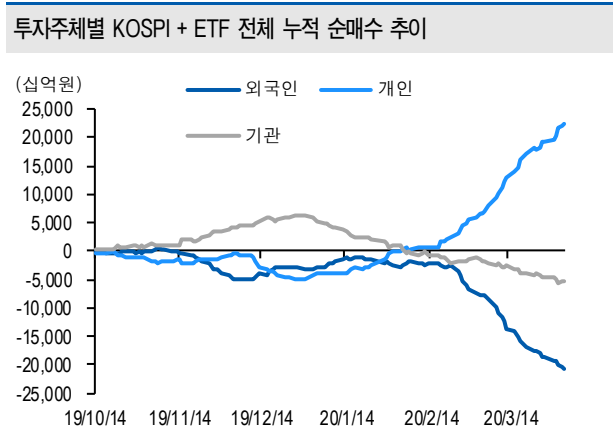
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	231.70	-0.06	-0.14	6,217.6	-
선물 6월물	231.65	0.00	0.00	24,469.0	339,870
선물 9월물	230.80	0.07	0.15	4.1	5,430
4월물(mini)	232.08	-0.01	-0.02	1,432.6	147,418
5월물(mini)	231.50	-0.06	-0.14	63.8	11,048

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.48	-0.94	-0.05	-0.61%	
베이스(mini)	0.04	-0.45	0.38	-0.21%	
제1스프레드(SP)	-0.21	-0.62	-0.60	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.04	0.37	0.37	0.14%	

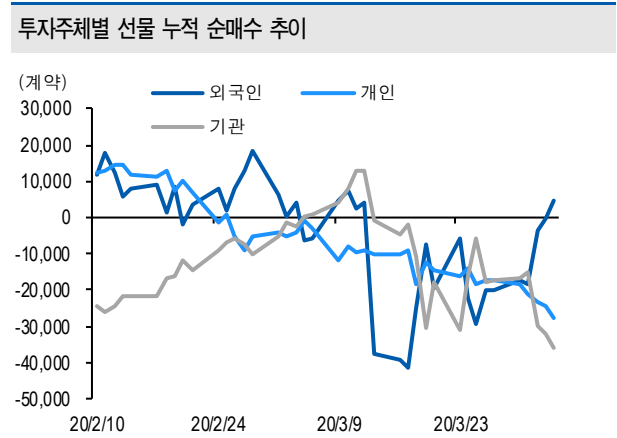


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-288.9	3.4	-285.5	-185.0	-159.3	384.5	-118.8	-4.7	-4.9	-4.4
개인	348.9	-57.2	291.7	0.0	-0.1	-179.2	1.3	1.6	4.1	-54.3
기관	-82.7	54.6	-28.1	-12.2	-16.3	-204.5	116.7	3.3	0.6	59.3
금융투자	-149.4	131.2	-18.2	-22.5	-10.3	-228.8	116.8	3.2	1.4	39.6
투신	24.3	-10.9	13.4	0.0	1.9	-20.7	0.0	-0.1	0.0	-5.9
은행+보험+기타금융	16.1	-15.2	0.9	0.0	-0.5	52.5	0.0	0.2	-0.8	0.4
연기금+국가지자체	43.1	-21.0	22.1	10.4	8.1	-7.5	-0.1	0.0	0.0	25.2
기타법인	22.7	-0.6	22.1	0.0	0.0	-0.8	0.7	-0.1	0.2	-0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





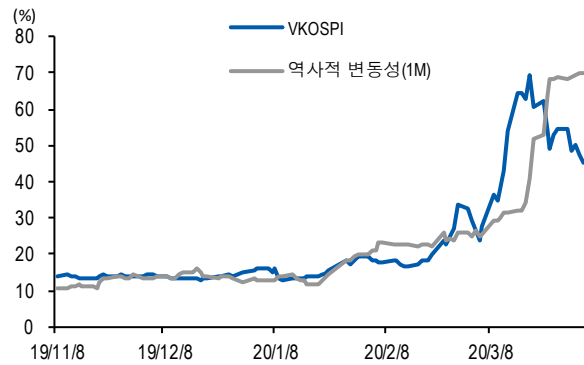
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,025,677	260.8	1,298,708	41.2%	지수옵션 전체	2,178,294	631.9	2,409,474
Put	1,152,617	371.1	1,110,766	48.2%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	45.34%(-1.90%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	240.0(K+3)	2.18	-0.64	81,357	13,496	613	40.8	Put	235.0(K+1)	7.11	-0.69	2,001	6,041	-81	41.3
	237.5(K+2)	3.03	-0.67	45,686	8,297	151	41.9		232.5(K+0)	5.91	-0.74	4,933	8,100	1,810	43.1
	235.0(K+1)	4.16	-0.64	15,604	9,684	-107	43.7		230.0(K-1)	4.92	-0.72	18,223	14,215	262	45.1
	232.5(K+0)	5.48	-0.76	9,378	8,885	1,012	45.6		227.5(K-2)	4.11	-0.66	14,162	15,861	854	47.3
	230.0(K-1)	6.99	-0.71	4,328	14,529	-124	47.7		225.0(K-3)	3.40	-0.63	36,141	8,449	963	49.1

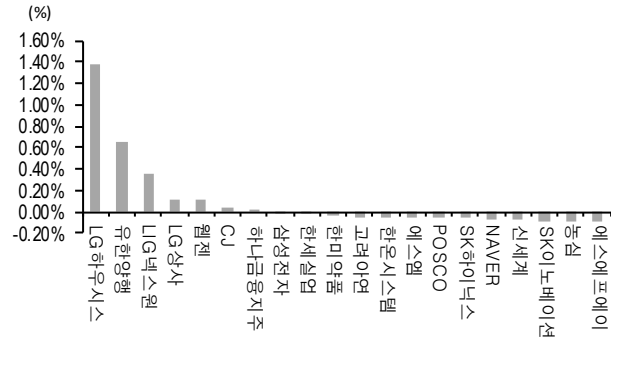
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,714,329	2,148.1	5,206,150	76,112	-19,120	-67,365	87,697	-4.4	-54.3	59.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	79,700	-0.75	273.1	91.6	212,404	-39,071	-0.06%	6,860	-8,347	1,643	340	19,235
삼성전자	47,050	0.43	672.2	63.4	1,942,522	24,384	0.00%	1,377	-51,352	50,862	61,502	2,871
하나금융지주	22,350	-1.11	17.9	60.3	133,756	-4,286	0.01%	1,556	-4,270	2,828	908	1,593
호텔신라	67,000	-1.18	19.7	59.6	26,922	133	-0.09%	981	-327	-654	-301	-640
현대백화점	57,800	0.70	1.8	46.9	6,188	-943	-0.09%	655	-1,246	591	281	311
KB 금융	31,150	-2.04	31.6	45.5	97,097	-508	-0.13%	-968	690	260	-4,736	4,500
삼성 SDI	232,000	-0.64	110.9	45.0	12,567	1,210	-0.73%	-120	227	-104	-644	70
LG 이노텍	110,500	-2.21	12.5	41.6	7,720	-1,056	-0.53%	-265	-361	626	-720	1,445
엔씨소프트	647,000	-1.37	24.7	40.9	4,132	115	-0.16%	45	-334	287	-131	0
GS 건설	19,400	-3.48	6.4	40.1	32,693	-3,935	-0.09%	1,256	-3,791	2,556	1,386	5,185

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터