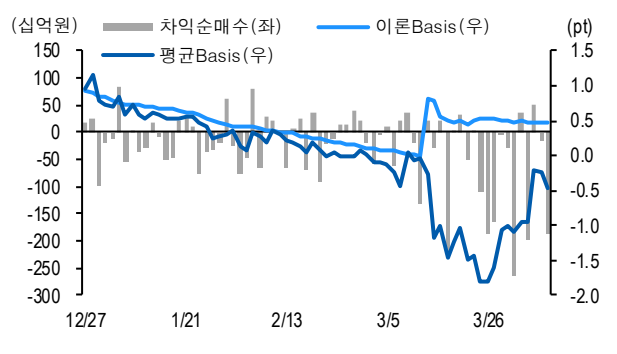
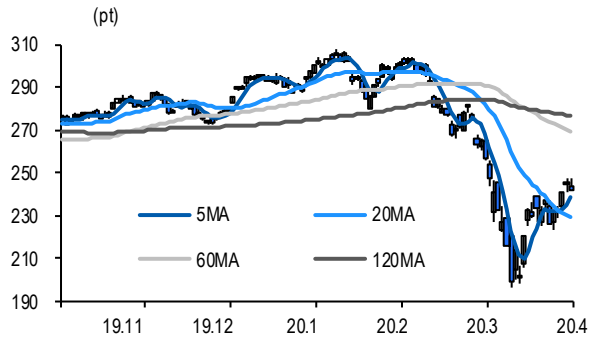




선물옵션시장 지표 2020.4.9

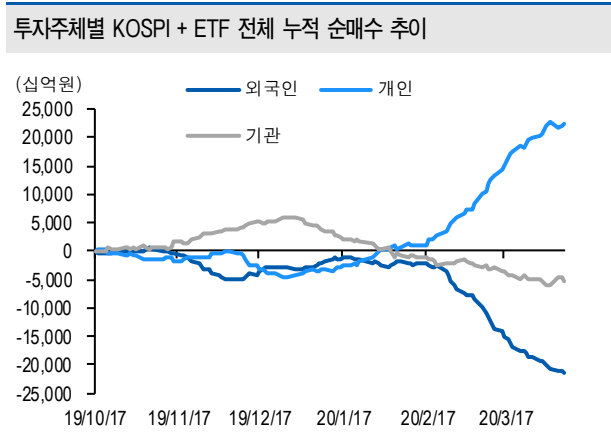
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	241.89	-1.22	-2.98	6,257.6	-
선물 6월물	241.50	-1.53	-3.75	28,488.5	328,307
선물 9월물	240.70	-1.61	-3.95	10.3	6,273
4월물(mini)	241.90	-1.39	-3.42	1,745.1	135,178
5월물(mini)	241.64	-1.44	-3.54	100.7	41,819

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.47	-0.46	-0.39	-0.38%	
베이스스(mini)	0.01	-0.10	0.01	-0.04%	
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.57	-0.50	-0.16%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.05	0.05	0.02%	

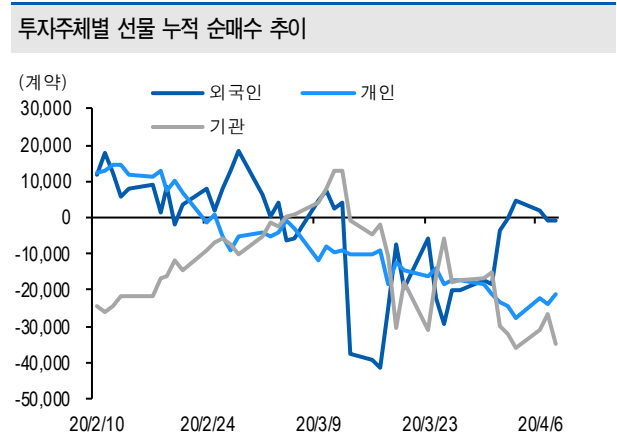


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-136.9	16.4	-120.5	-25.7	-210.9	355.6	-345.1	0.8	0.7	13.1
개인	458.7	89.6	548.3	0.0	-0.2	143.1	-0.3	4.5	0.9	39.2
기관	-286.3	-107.2	-393.5	-163.1	29.0	-504.2	345.5	-5.5	-1.8	-52.5
금융투자	-361.4	-96.0	-457.4	-5.5	-11.5	-120.0	345.8	-4.4	-0.9	-18.9
투신	34.0	-9.8	24.2	0.0	-19.9	-469.3	-0.4	-1.5	-0.3	-43.3
은행+보험+기타금융	13.1	-22.2	-9.1	0.0	0.5	-74.2	0.0	0.3	-0.7	-0.3
연기금+국가지자체	40.4	8.9	49.2	-157.6	66.8	159.2	0.1	0.0	0.0	10.0
기타법인	-35.5	2.4	-33.2	0.0	0.0	5.5	-0.1	0.2	0.3	0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

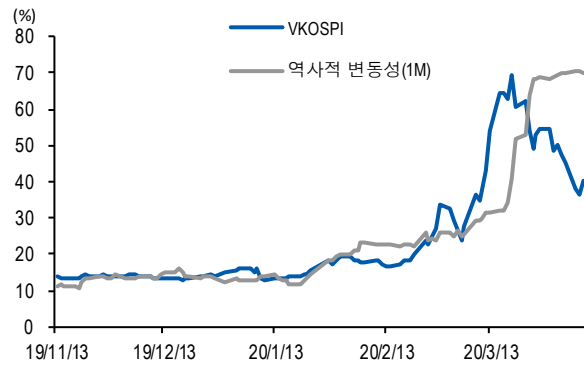
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,075,494	452.9	1,351,968	37.2%	지수옵션 전체	4,080,187	897.5	2,651,440
Put	2,004,693	444.6	1,299,472	41.0%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	40.05%(+3.91%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	252.5(K+3)	0.17	-0.73	275,941	22,375	4,243	37.0	Put	247.5(K+1)	6.27	1.66	10,020	7,519	1,321	35.4
	250.0(K+2)	0.38	-1.15	338,251	25,072	4,321	37.1		245.0(K+0)	4.47	1.11	55,674	14,677	5,360	36.7
	247.5(K+1)	0.75	-1.67	225,575	22,847	4,119	36.9		242.5(K-1)	3.02	0.59	147,566	10,612	2,676	37.9
	245.0(K+0)	1.41	-2.24	209,747	22,977	6,706	37.3		240.0(K-2)	2.02	0.27	196,472	18,627	3,007	40.4
	242.5(K-1)	2.50	-2.80	38,609	11,263	3,395	39.0		237.5(K-3)	1.29	0.04	192,453	11,475	903	42.2

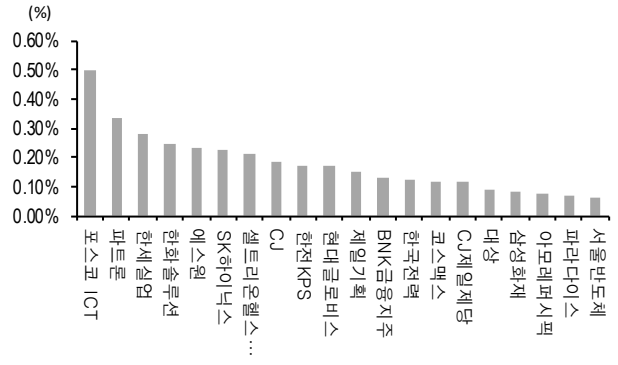
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,872,876	2,214.4	5,183,456	-161,789	9,907	52,644	-63,775	13.1	39.2	-52.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	159,500	-0.93	86.1	73.7	50,930	6,685	0.04%	9,745	-283	-9,513	-1,558	-6,853
호텔신라	73,600	0.55	43.1	57.8	16,757	-3,720	0.03%	-1,691	1,666	30	3,678	-7,347
삼성전자	48,550	-2.31	666.7	54.4	769,753	-646,797	-0.06%	7,645	7,918	-15,629	17,487	73,475
SK 하이닉스	84,700	-1.85	156.9	49.5	179,031	-75,782	0.23%	301	8,971	-9,332	-19,446	4,176
LG 이노텍	126,500	-1.56	20.2	47.8	7,969	-3,723	-0.20%	-246	94	155	-2,704	2,880
삼성 SDI	249,000	1.43	110.2	41.0	11,713	-2,102	0.03%	-1,237	489	1,032	2,808	-1,600
엔씨소프트	665,000	-2.21	28.5	40.4	2,159	-1,715	-0.07%	23	1,559	-1,583	-1,135	-65
LG 화학	307,000	-0.81	75.5	39.0	11,277	-872	0.03%	-204	2,533	-2,316	544	-3,138
LG 전자	52,800	-3.12	29.1	35.4	32,309	-11,751	-0.10%	183	-7,315	7,131	1,870	6,677
신세계	231,000	2.21	10.5	33.3	2,261	164	-0.06%	70	-231	164	136	-450

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터