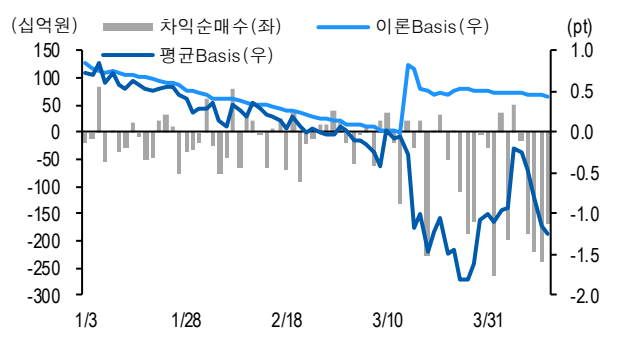
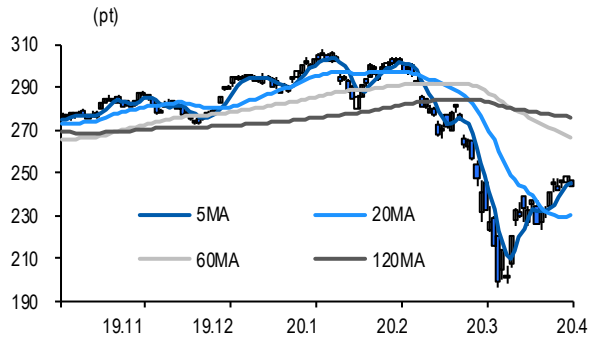




선물옵션시장 지표 2020.4.14

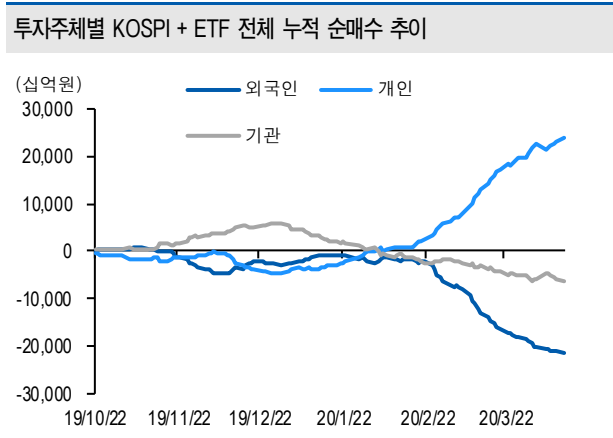
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	243.40	-1.85	-4.60	6,076.0	-
선물 6월물	242.00	-2.06	-5.10	16,647.8	321,578
선물 9월물	241.80	-1.87	-4.60	10.1	6,364
5월물(mini)	242.50	-1.91	-4.72	1,026.8	67,007
6월물(mini)	242.00	-2.06	-5.06	92.7	37,347

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.43	-1.26	-1.40	-0.70%	
베이스스(mini)	0.23	-0.88	-0.90	-0.45%	
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.59	-0.55	-0.17%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.23	-0.95	-0.95	-0.48%	

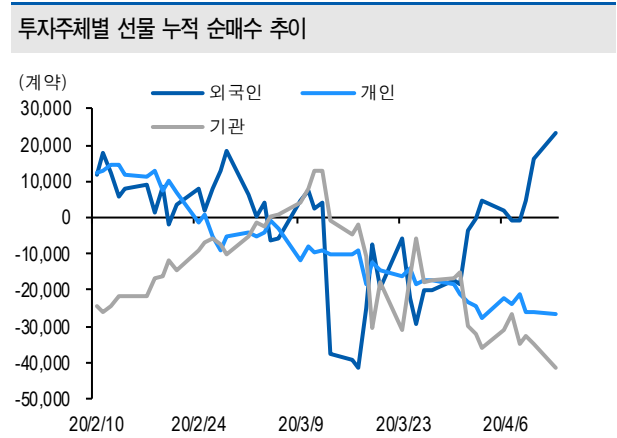


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-292.3	-58.1	-350.4	0.0	-196.3	397.8	30.1	-1.0	-0.1	28.5	
개인	760.0	162.4	922.4	0.0	-0.3	-31.0	-0.7	1.2	-0.4	-37.5	
기관	-457.7	-109.4	-567.1	-167.7	14.9	-379.7	-28.7	0.3	1.0	10.4	
금융투자	-380.4	-129.2	-509.5	-175.2	-49.6	328.5	-28.5	0.6	0.9	2.6	
투신	-51.4	-7.5	-58.9	-2.5	-13.2	-659.5	-0.2	-0.3	0.1	-26.5	
은행+보험+기타금융	-17.2	-4.5	-21.7	0.0	-5.5	-37.6	0.0	0.0	0.0	1.9	
연기금+국가자자체	39.0	-1.1	37.8	11.2	110.9	-11.1	0.0	0.0	0.0	32.4	
기타법인	-10.0	4.8	-5.2	0.0	0.0	12.9	-0.7	-0.5	-0.5	-1.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	377,897	185.8	649,858	29.4%	지수옵션 전체	822,877	440.0	1,432,872
Put	444,980	254.2	783,014	36.6%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	39.69%(+3.85%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	255.0(K+3)	3.98	-1.43	13,488	4,578	505	28.8	Put	250.0(K+1)	13.35	2.75	743	2,845	174	33.8
	252.5(K+2)	4.89	-1.67	16,590	4,035	-700	29.4		247.5(K+0)	12.15	2.63	868	574	140	34.9
	250.0(K+1)	5.96	-1.87	9,427	8,137	692	30.1		245.0(K-1)	10.90	2.35	3,459	4,643	210	35.4
	247.5(K+0)	7.10	-2.14	4,281	4,040	501	30.7		242.5(K-2)	9.84	2.15	4,535	2,722	691	36.3
	245.0(K-1)	8.39	-2.41	2,191	8,954	159	31.4		240.0(K-3)	8.89	1.99	8,272	3,643	469	37.2

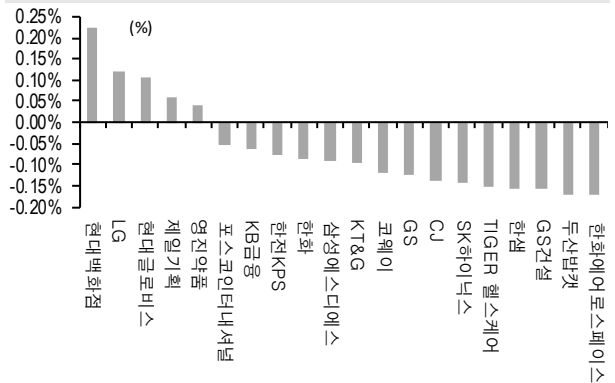
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,620,816	1,485.3	3,866,163	14,728	37,428	-64,238	29,622	28.5	-37.5	10.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	81,400	-2.98	208.1	70.6	249,281	-23,003	-0.14%	1,589	731	-2,293	-13,098	15,159
삼성전자	48,200	-2.13	421.2	60.3	1,420,870	-36,509	-0.23%	25,245	-26,903	2,209	12,786	11,423
호텔신라	71,900	-3.49	18.3	52.8	29,092	-711	-0.66%	201	-241	40	-479	525
POSCO	181,500	1.97	91.1	49.5	27,132	-1,757	-0.27%	-772	-965	1,946	2,018	526
신세계	232,500	-3.13	8.0	46.4	3,407	-602	-0.19%	37	-17	-20	-23	594
현대차	96,600	-2.42	52.9	40.5	56,764	1,360	-1.17%	6,019	-2,884	-2,976	-532	4,350
KODEX 삼성그룹	5,975	-1.40	0.5	39.1	231	-100	-1.59%	0	-99	99	99	0
대림산업	74,600	-0.80	11.3	38.4	6,922	240	-0.34%	1,587	-1,133	-454	-376	-78
GS 건설	22,750	-0.66	6.6	38.2	20,410	2,135	-0.16%	-804	2,519	-1,715	-3,335	1,620
롯데케미칼	179,500	-2.18	9.0	36.4	3,848	317	-0.86%	-195	-625	821	526	10

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

