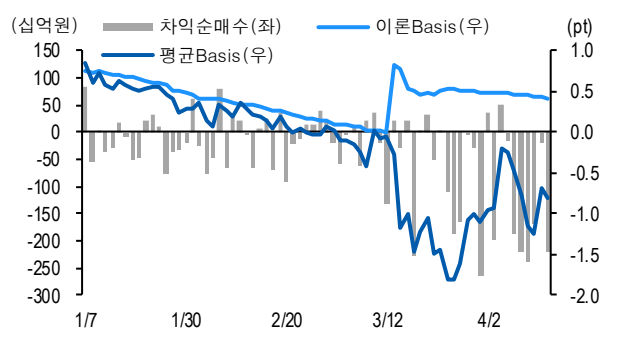
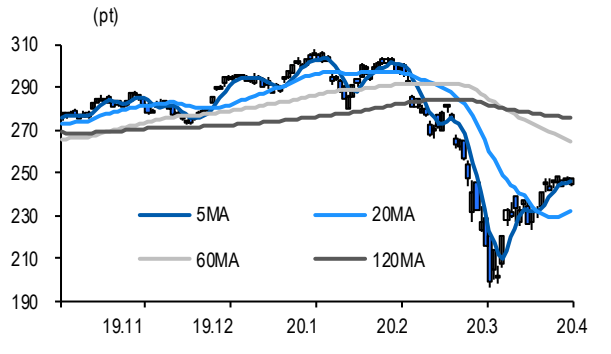




선물옵션시장 지표 2020.4.17

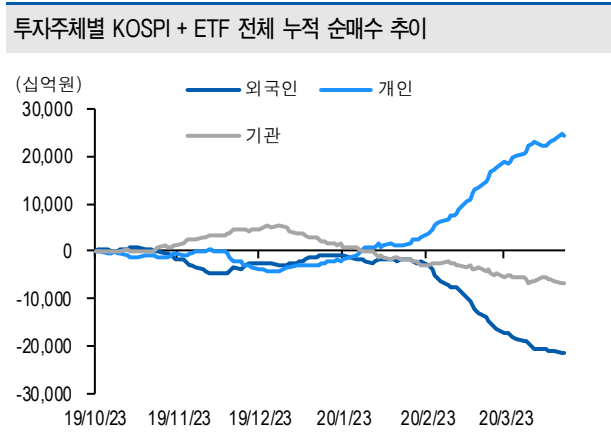
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	247.10	-0.14	-0.35	6,965.3	-
선물 6월물	247.20	0.16	0.40	19,211.7	329,638
선물 9월물	246.05	-0.16	-0.40	9.4	6,399
5월물(mini)	247.50	0.19	0.46	1,271.9	66,793
6월물(mini)	246.92	0.05	-0.08	78.7	32,952

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.42	-0.82	0.10	-0.50%	
베이스스(mini)	0.21	-0.45	0.40	-0.27%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.61	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.21	0.46	0.46	0.10%	

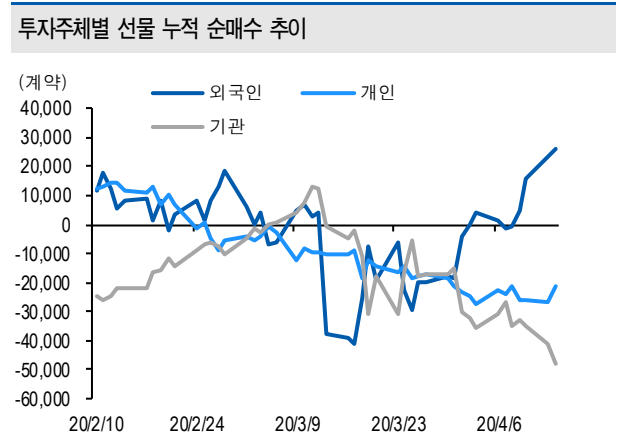


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-568.5	15.9	-552.6	-185.3	-380.7	321.7	-27.6	-3.1	1.2	0.6
개인	389.2	235.2	624.4	0.0	0.9	-147.5	-4.1	-0.2	-1.0	9.7
기관	135.6	-266.5	-130.9	-36.0	60.7	-166.8	32.1	3.2	-0.3	-9.3
금융투자	-100.6	-290.4	-391.0	-50.0	-14.6	48.8	32.2	3.4	-0.2	22.5
투신	-2.7	20.2	17.5	-1.8	-3.7	-190.6	-0.2	0.0	-0.1	-0.3
은행+보험+기타금융	8.0	-5.4	2.6	0.0	-2.1	1.3	0.0	-0.3	0.0	0.5
연기금+국가지자체	229.3	1.7	231.0	15.9	92.0	-26.3	0.0	0.0	0.0	-32.0
기타법인	43.7	13.3	57.0	0.0	0.1	-7.4	-0.4	0.1	0.1	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	481,480	213.1	698,497	28.1%	지수옵션 전체	1,032,676	481.5	1,548,330		
Put	551,196	268.5	849,833	31.8%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	34.82%(-1.22%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	255.0(K+3)	4.58	-0.27	20,821	5,929	650	27.7	Put	250.0(K+1)	9.40	-0.70	978	3,491	285	28.6
	252.5(K+2)	5.67	-0.25	10,098	5,319	398	28.5		247.5(K+0)	8.28	-0.66	1,539	1,319	138	29.5
	250.0(K+1)	6.93	-0.23	9,230	8,426	227	29.4		245.0(K-1)	7.34	-0.64	5,679	6,186	501	30.6
	247.5(K+0)	8.34	-0.21	5,168	5,072	544	30.3		242.5(K-2)	6.49	-0.63	4,670	2,897	147	31.6
	245.0(K-1)	9.85	-0.25	2,175	9,472	253	31.3		240.0(K-3)	5.74	-0.55	7,366	4,564	515	32.6

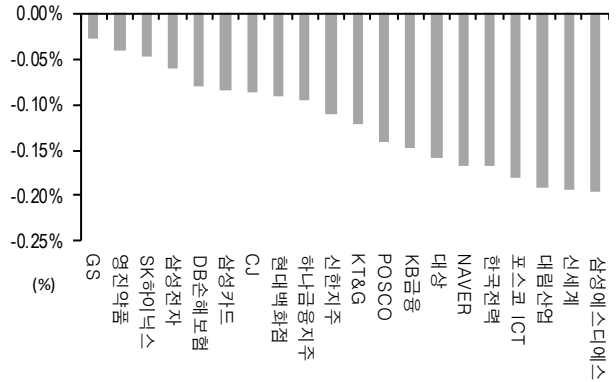
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,482,411	1,477.9	4,191,293	112,186	-8,822	25,253	-13,145	0.6	9.7	-9.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	81,700	-0.73	213.6	58.9	261,694	-4,270	-0.05%	2,532	6,788	-8,982	-7,823	-1,516
KODEX 삼성그룹	6,105	1.24	0.7	56.9	308	77	-1.68%	0	80	-80	-80	0
LG 이노텍	126,500	3.27	12.8	41.7	8,678	1,678	-0.38%	165	629	-924	-606	-840
호텔신라	73,300	0.69	15.4	40.8	26,556	1,124	-1.30%	772	-19	-753	-1,091	-28
카카오	166,000	4.08	67.1	40.6	30,193	4,250	-0.23%	135	500	-679	437	-1,913
삼성 SDI	272,000	8.37	119.2	36.8	14,054	4,400	-0.24%	202	-697	473	3,576	-3,765
현대건설	32,850	2.34	16.3	35.3	8,812	1,605	-0.53%	1,372	-966	-306	364	1,737
삼성전자	49,150	0.31	389.9	35.2	1,479,924	17,933	-0.06%	8,674	-6,895	37	20,833	-24,741
GS 건설	23,650	0.42	4.9	34.9	21,661	1,377	-0.31%	-312	1,814	-1,502	493	-1,995
대림산업	75,200	-1.18	8.3	33.8	10,339	2,011	-0.19%	-314	2,504	-2,198	-446	-1,757

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표