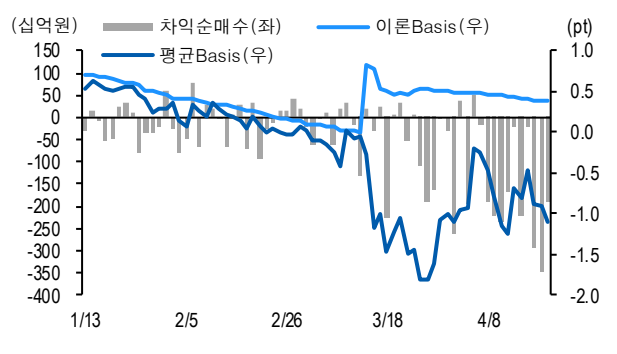
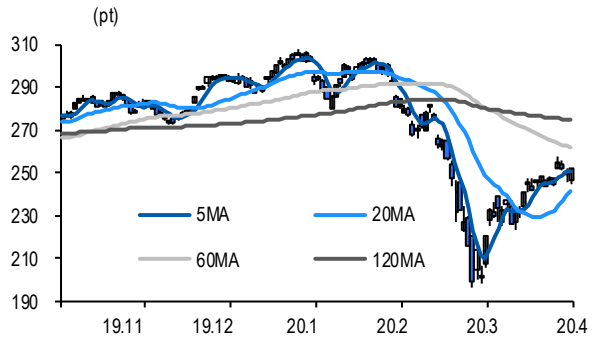




선물옵션시장 지표 2020.4.23

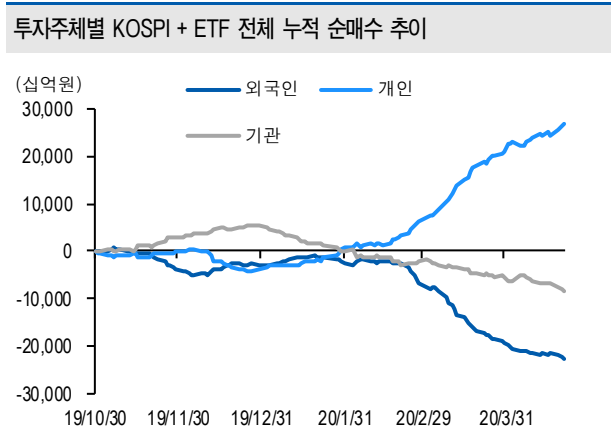
Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	251.88	0.99	2.48	6,328.1	-	
선물 6월물	250.75	0.95	2.35	23,869.8	331,877	
선물 9월물	250.30	0.97	2.40	13.1	6,509	
5월물(mini)	251.16	0.89	2.22	1,196.9	73,443	
6월물(mini)	250.70	0.93	2.04	151.7	43,675	

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.38	-1.11	-1.13	-0.59%	
베이스(mini)	0.17	-0.60	-0.72	-0.30%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.60	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스(ATM)	0.17	-0.67	-0.67	-0.33%	

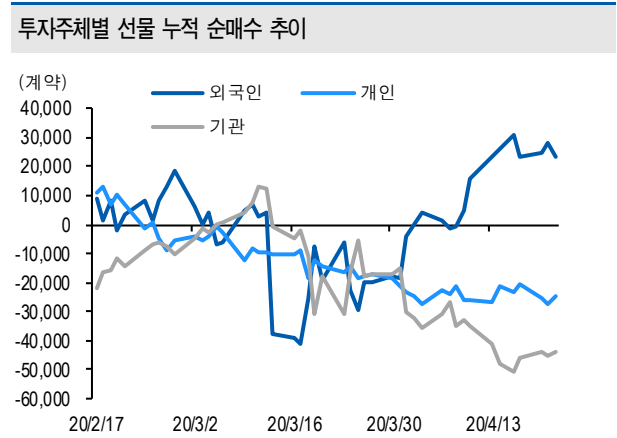


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-38.1	-27.3	-65.3	-16.1	2.9	-262.6	-46.0	-0.5	0.7	-2.8	
개인	317.5	265.8	583.3	0.0	-0.5	179.3	-2.8	-0.9	-0.2	6.3	
기관	-307.0	-244.3	-551.4	-173.0	-105.4	87.2	51.8	1.1	0.0	-5.8	
금융투자	-355.5	-164.6	-520.1	-169.2	-75.3	-313.4	53.3	2.3	0.9	11.8	
투신	-25.8	26.9	1.1	0.0	-29.3	347.1	-1.4	-0.9	-0.1	-18.5	
은행+보험+기타금융	-27.6	-31.4	-58.9	0.0	-17.1	-19.6	0.0	-0.3	-0.8	1.8	
연기금+국가지자체	134.4	-91.8	42.6	-3.8	31.8	73.1	0.0	0.0	0.0	-0.8	
기타법인	27.6	4.8	32.4	0.0	-0.7	-3.8	-3.0	0.3	-0.5	2.3	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

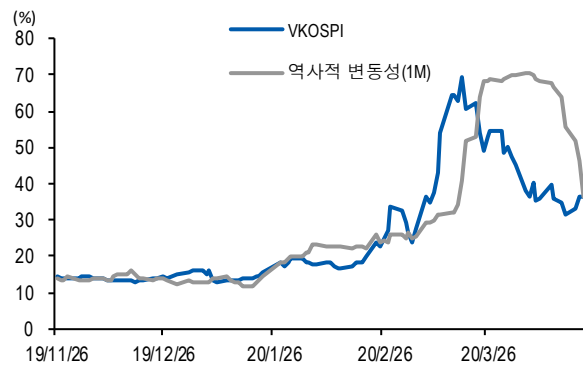
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성	지수옵션 전체	거래량	거래대금	미결제약정
Call	654,017	250.8	821,994	28.0%		1,352,152	604.9	1,802,560
Put	698,135	354.2	980,566	36.0%	PCR(금액기준)	1.41	VKOSPI	36.55%(+0.02%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	257.5(K+3)	4.67	0.91	35,484	7,645	349	27.7	Put	252.5(K+1)	8.48	-1.11	971	2,206	82	32.7
	255.0(K+2)	5.86	1.04	30,266	7,522	412	28.5		250.0(K+0)	7.46	-0.99	2,318	5,524	345	33.6
	252.5(K+1)	7.20	1.21	16,659	7,381	834	29.4		247.5(K-1)	6.55	-0.83	5,718	3,261	-22	34.6
	250.0(K+0)	8.67	1.31	12,497	9,332	121	30.3		245.0(K-2)	5.78	-0.73	10,293	8,955	1,191	35.6
	247.5(K-1)	10.30	1.50	2,843	5,535	-230	31.3		242.5(K-3)	5.08	-0.64	6,970	4,362	391	36.7

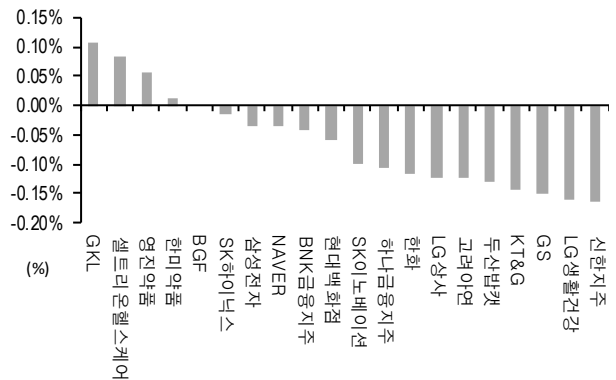
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,639,823	2,268.6	4,653,207	139,029	-33,550	61,261	-30,293	-2.8	6.3	-5.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	83,900	2.82	410.3	94.4	311,961	11,153	-0.01%	-2,314	-16,751	18,388	1,452	8,319
삼성전자	49,900	1.42	595.8	65.4	1,487,217	8,410	-0.03%	-19,721	24,267	-4,616	-1,777	292
카카오	176,000	0.86	77.4	64.7	30,705	2,756	-0.22%	256	1,612	-2,073	-569	-1,534
롯데케미칼	201,500	-0.49	22.0	63.4	6,897	1,885	-0.84%	1,517	-518	-992	73	-366
신세계	251,500	-2.90	22.7	54.3	1,323	-2,856	-0.38%	144	112	-256	1,641	1,312
GS 건설	25,100	3.93	9.6	50.5	33,161	9,221	-0.20%	315	9,352	-9,667	-4,321	-2,818
LG 화학	354,000	0.00	63.9	50.5	10,866	-1,252	-0.20%	-39	-242	278	-191	1,196
대림산업	85,200	4.80	19.3	44.9	12,749	3,449	-0.25%	-164	2,946	-2,782	-529	-2,312
NAVER	181,500	1.68	48.4	44.4	38,600	4,775	-0.04%	-6	591	-1,110	345	-1,448
삼성 SDI	285,000	1.06	75.2	42.9	8,787	-761	-0.28%	-188	-705	898	324	1,058

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

