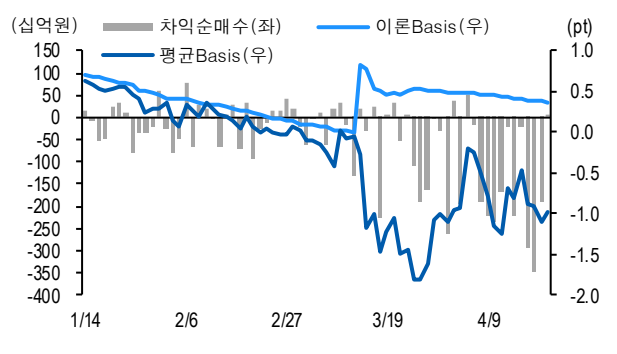
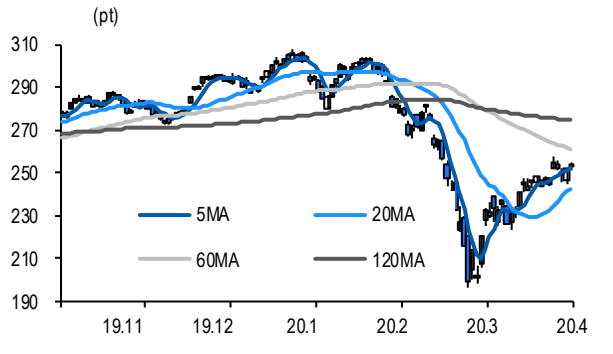




선물옵션시장 지표 2020.4.24

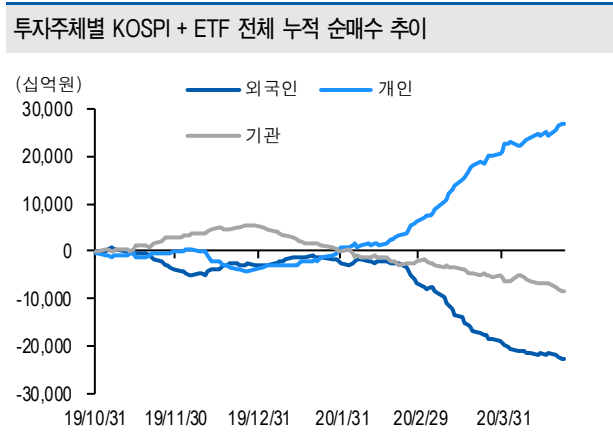
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	253.74	0.74	1.86	6,576.9	-
선물 6월물	254.15	1.36	3.40	22,069.0	330,586
선물 9월물	252.80	1.00	2.50	20.9	7,035
5월물(mini)	254.46	1.31	3.30	1,253.1	72,586
6월물(mini)	253.80	1.21	3.10	193.6	42,027

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.37	-0.97	0.41	-0.53%	
베이스(mini)	0.16	-0.51	0.72	-0.26%	
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.62	-0.60	-0.19%	
합성선물 베이스(ATM)	0.16	0.82	0.82	0.26%	

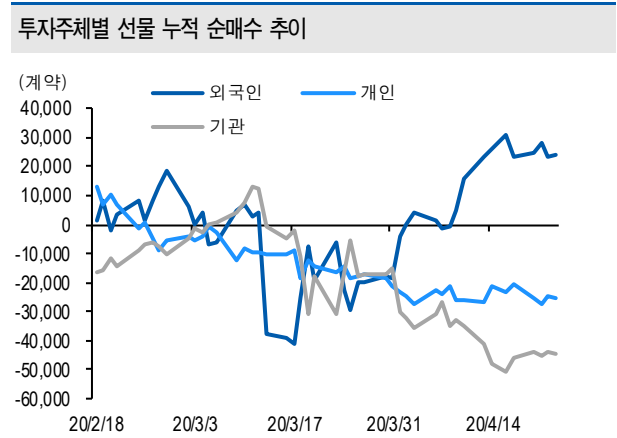


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-106.0	14.6	-91.4	-2.8	-103.2	-4.3	60.5	2.4	8.4	17.9
개인	-15.3	-11.3	-26.6	0.0	1.0	-4.8	-6.5	-2.0	2.4	3.1
기관	99.5	-7.6	91.9	5.5	-70.2	-39.0	-55.2	-0.8	-11.0	-20.7
금융투자	-53.8	36.7	-17.1	-78.5	-27.5	-45.4	-55.8	-0.4	-10.1	4.2
투신	33.2	-1.2	31.9	0.0	-16.9	63.1	0.6	0.0	0.0	-27.4
은행+보험+기타금융	4.3	-3.1	1.2	0.0	-15.0	-6.6	0.0	-0.3	-1.0	-0.1
연기금+국가지자체	98.1	-39.7	58.4	83.9	-8.2	-50.1	0.0	0.0	0.0	2.6
기타법인	21.7	5.4	27.1	0.0	0.0	48.1	1.2	0.4	0.3	-0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

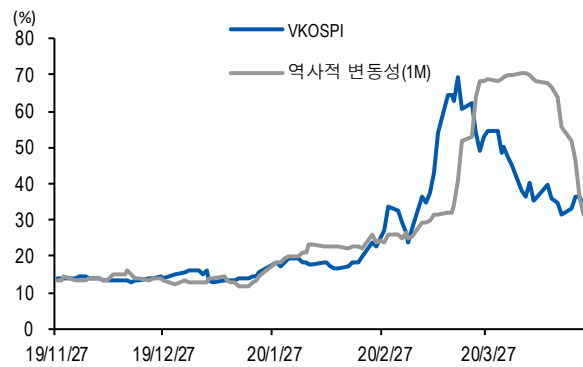
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	675,246	257.0	819,381	27.5%	지수옵션 전체	1,259,505	511.5	1,823,793
Put	584,259	254.5	1,004,412	31.0%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	34.46%(-2.09%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	260.0(K+3)	4.26	0.62	43,328	16,663	798	27.4	Put	255.0(K+1)	7.31	-2.16	1,401	1,713	125	27.1
	257.5(K+2)	5.48	0.81	13,423	7,440	-205	28.5		252.5(K+0)	6.32	-2.16	4,191	2,450	244	28.3
	255.0(K+1)	6.84	0.98	9,379	7,575	53	29.6		250.0(K-1)	5.55	-1.91	8,774	5,862	338	29.8
	252.5(K+0)	8.38	1.18	3,781	7,104	-277	30.9		247.5(K-2)	4.80	-1.75	8,206	3,453	192	30.9
	250.0(K-1)	10.05	1.38	1,475	9,108	-224	32.2		245.0(K-3)	4.20	-1.58	9,463	9,074	119	32.2

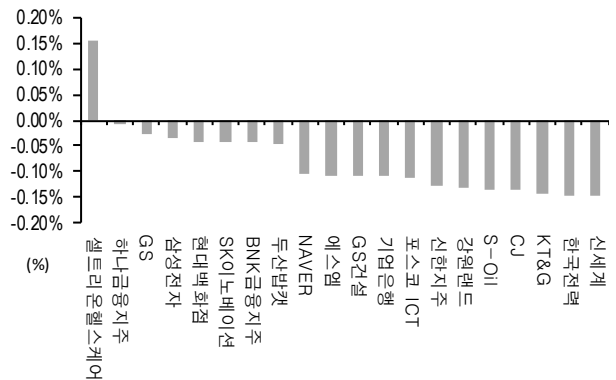
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,289,885	2,284.0	4,624,123	-29,084	42,743	-14,972	-29,929	17.9	3.1	-20.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	82,600	-1.55	455.7	85.4	196,172	-115,789	-0.15%	6,363	1,996	-8,027	16,227	42,545
기아차	28,900	1.94	37.2	66.1	65,665	19,479	-0.34%	-2,492	132	1,810	-7,371	-4,180
삼성전자	49,850	-0.10	570.2	63.6	1,478,870	-8,347	-0.03%	29,265	-13,685	-16,810	-2,028	-24,437
LG 화학	361,500	2.12	67.9	56.6	12,922	2,056	-0.15%	-426	227	201	415	-1,622
현대차	92,300	-0.22	152.3	51.6	75,532	-1,137	-0.29%	265	276	-303	-4,325	4,671
NAVER	190,500	4.96	144.2	51.1	38,178	-422	-0.10%	404	3,364	-3,218	-2,692	-434
POSCO	172,000	1.18	28.9	50.6	29,754	93	-0.18%	-372	-126	498	811	-339
GS 건설	24,900	-0.80	5.4	48.7	31,610	-1,551	-0.11%	1,409	-1,481	72	376	-301
삼성 SDI	284,500	-0.18	77.0	44.9	9,616	829	-0.21%	-1,538	46	1,475	772	392
LG 전자	53,000	1.53	15.7	43.5	41,297	-296	-0.22%	100	-605	505	511	1,380

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터