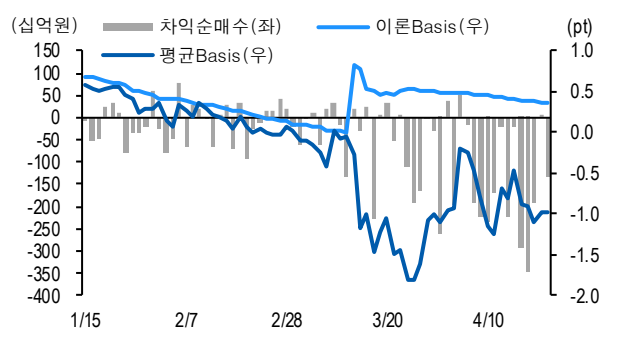
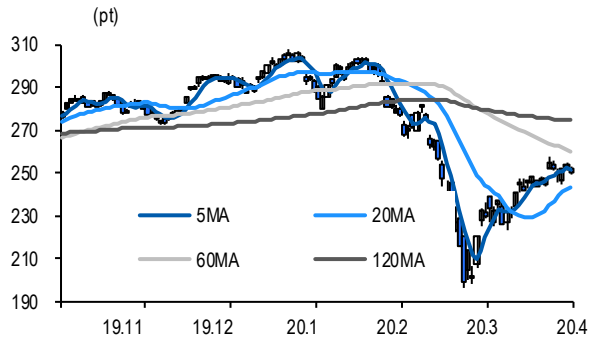




선물옵션시장 지표 2020.4.27

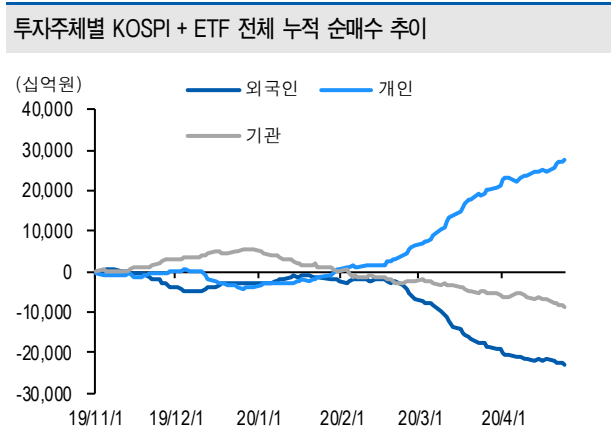
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	250.28	-1.36	-3.46	5,485.0	-
KSP2006	248.95	-2.05	-5.20	19,995.6	335,318
KSP2009	248.35	-1.76	-4.45	9.3	7,774
KSP2005(mini)	249.44	-1.97	-5.02	1,154.0	74,225
KSP2006(mini)	248.88	-2.08	-4.92	170.9	45,207

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.36	-0.99	-1.33	-0.54%	
베이스스(mini)	0.15	-0.47	-0.84	-0.25%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.61	-0.65	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.15	-0.86	-0.86	-0.40%	

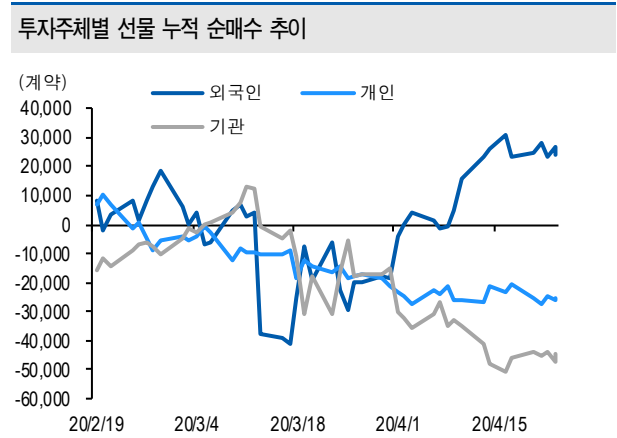


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-231.3	-9.3	-240.5	-35.2	-266.0	255.0	-84.0	-2.2	-1.4	-23.0	
개인	633.6	62.2	695.8	0.0	-0.4	-84.1	9.2	2.2	1.1	-45.6	
기관	-423.4	-57.2	-480.6	-95.8	-31.4	-146.6	74.0	0.0	0.1	69.0	
금융투자	-223.6	-59.3	-282.9	-21.4	-12.1	268.1	73.8	0.2	0.1	20.0	
투신	-31.2	-4.6	-35.8	0.0	-12.0	-531.6	0.1	-0.1	0.1	-2.6	
은행+보험+기타금융	-6.2	7.8	1.6	0.0	-3.0	40.9	0.0	0.0	0.0	3.1	
연기금+국가자차체	-140.3	-0.5	-140.9	-74.4	-3.0	75.9	0.0	0.0	0.0	48.6	
기타법인	21.1	3.6	24.7	0.0	0.0	-24.3	0.8	0.0	0.1	-0.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





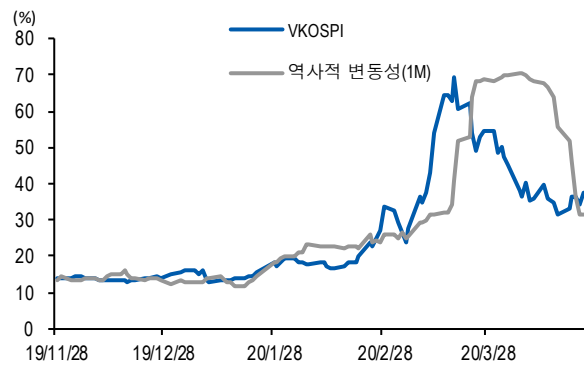
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	519,902	176.2	836,087	26.2%	지수옵션 전체	1,197,202	488.7	1,843,542		
Put	677,300	312.4	1,007,455	34.2%	PCR(금액기준)	1.77	VKOSPI	37.54%(+3.08%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	260.0(K+3)	2.71	-1.55	40,901	16,181	-482	26.2	Put	255.0(K+1)	10.15	2.84	1,358	2,003	290	31.7
	257.5(K+2)	3.57	-1.91	13,352	7,270	-170	26.8		252.5(K+0)	8.88	2.56	4,810	2,670	220	32.5
	255.0(K+1)	4.58	-2.26	9,481	8,439	864	27.4		250.0(K-1)	7.75	2.20	8,836	6,591	729	33.3
	252.5(K+0)	5.80	-2.58	3,232	7,212	108	28.2		247.5(K-2)	6.78	1.98	9,306	3,938	485	34.3
	250.0(K-1)	7.18	-2.87	2,503	9,153	45	29.1		245.0(K-3)	5.95	1.75	9,256	9,090	16	35.4

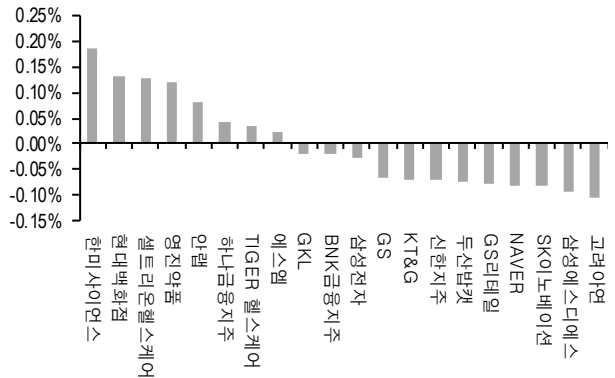
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,782,553	1,754.6	4,619,896	-4,227	-40,880	-79,202	121,130	-23.0	-45.6	69.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
KODEX												
삼성그룹	6,245	-1.58	0.8	89.0	75	-284	-1.58%	0	-282	282	282	0
카카오	183,000	-1.08	136.7	68.9	35,421	-1,842	-0.20%	-863	-1,832	3,150	1,831	1,587
기아차	27,800	-3.81	40.7	66.3	59,031	-6,634	-0.57%	2,839	-6,621	4,632	369	10,384
삼성전자	49,200	-1.30	472.2	61.4	1,436,067	-42,803	-0.03%	-33,127	-49,617	83,674	32,918	50,109
삼성전기	107,500	-2.27	44.2	59.3	44,118	-3,924	-0.33%	632	-3,328	2,679	199	2,492
롯데케미칼	212,000	-1.40	27.0	50.8	9,981	971	-0.27%	-739	543	200	-1,195	-274
LG 이노텍	125,000	-2.72	9.6	49.7	9,239	-1,670	-0.46%	-396	-1,031	1,478	1,213	364
LG 화학	351,500	-2.77	47.4	49.6	11,763	-1,159	-0.19%	-1	-79	21	-918	1,204
NAVER	192,000	0.79	82.9	46.3	38,284	106	-0.08%	-514	-21	474	64	410
SK 하이닉스	81,100	-1.82	117.9	45.4	192,915	-3,257	-0.13%	-6,940	-1,707	8,748	13,922	-231

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

