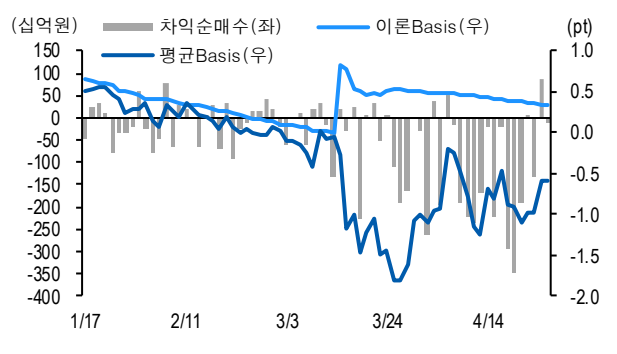
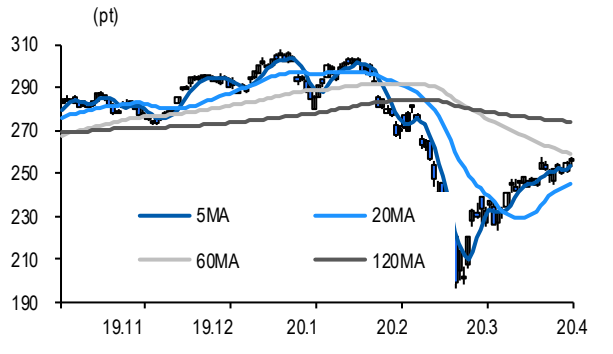




선물옵션시장 지표 2020.4.29

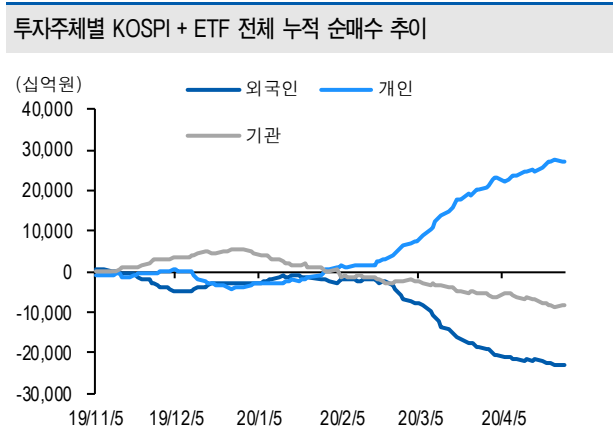
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	256.39	0.61	1.55	5,938.7	-
선물 6월물	256.00	0.57	1.45	19,203.7	332,053
선물 9월물	255.10	0.47	1.20	9.7	7,760
5월물(mini)	256.16	0.55	1.40	1,349.1	73,249
6월물(mini)	255.86	0.51	1.38	122.8	45,582

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.34	-0.59	-0.39	-0.36%	
베이스(mini)	0.12	-0.27	-0.23	-0.15%	
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.66	-0.70	-0.20%	
합성선물 베이스(ATM)	0.12	-0.21	-0.21	-0.13%	

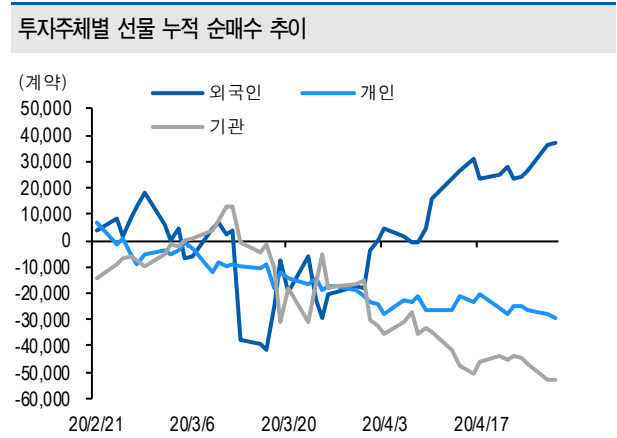


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-125.7	35.7	-89.9	-8.5	-88.2	104.3	-68.0	0.1	-3.9	-2.1	
개인	83.3	-11.1	72.2	0.0	0.5	-95.4	0.4	0.0	1.0	-21.4	
기관	23.8	-13.1	10.7	-1.5	-35.7	-8.0	67.6	0.0	2.8	24.3	
금융투자	-22.8	-30.4	-53.2	0.0	-1.6	93.1	67.3	0.2	2.7	-4.5	
투신	-9.8	2.3	-7.5	0.0	-23.0	-127.1	0.3	-0.1	0.1	19.0	
은행+보험+기타금융	15.1	11.4	26.5	0.0	-3.2	31.7	0.0	-0.1	0.0	-0.1	
연기금+국가자재	39.4	0.7	40.1	-1.5	0.3	-5.7	0.1	0.0	0.0	9.9	
기타법인	18.5	-11.5	7.0	0.0	0.0	-0.9	0.0	0.0	0.1	-0.8	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	552,668	195.9	847,100	23.1%	지수옵션 전체	1,266,573	444.8	1,930,865
Put	713,905	248.9	1,083,765	31.4%	PCR(금액기준)	1.27	VKOSPI	32.64%(-2.51%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	262.5(K+3)	2.71	-0.14	55,767	11,754	1,037	23.1	Put	257.5(K+1)	6.38	-1.40	1,158	1,431	202	26.6
	260.0(K+2)	3.76	-0.05	34,111	17,706	439	23.9		255.0(K+0)	5.37	-1.27	5,803	3,107	793	27.7
	257.5(K+1)	5.01	0.04	8,566	7,619	327	24.8		252.5(K-1)	4.57	-1.11	5,877	3,234	302	29.1
	255.0(K+0)	6.55	0.19	7,027	8,900	67	26.2		250.0(K-2)	3.89	-0.99	10,555	7,879	690	30.5
	252.5(K-1)	8.21	0.31	1,158	6,957	-44	27.3		247.5(K-3)	3.32	-0.87	14,720	4,742	113	31.9

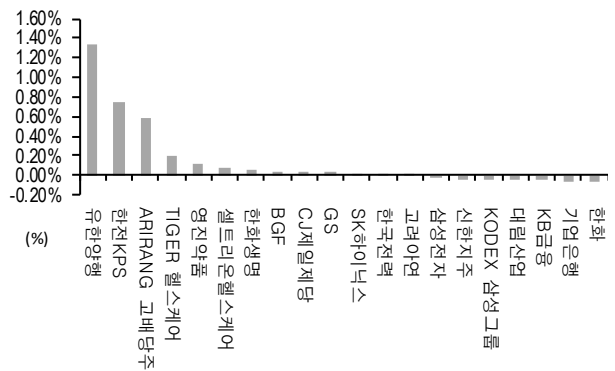
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,340,739	1,968.2	4,743,467	-20,081	-23,428	-51,378	77,376	-2.1	-21.4	24.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	83,600	0.97	246.3	92.9	203,469	-965	0.02%	17,581	-18,145	577	-3,689	-13,877
삼성전자	50,200	0.70	492.7	63.1	1,436,940	-8,520	-0.01%	-23,397	-12,035	34,838	4,271	25,863
삼성전기	110,000	-0.45	51.1	59.8	45,945	-2,595	-0.46%	974	-3,264	2,337	-1,036	4,342
삼성 SDI	280,000	0.54	83.3	58.6	10,923	1,444	-0.17%	-356	1,296	-910	469	-1,358
LG 화학	362,500	2.55	120.6	57.3	11,931	55	-0.15%	-685	81	736	892	-64
카카오	184,000	0.27	66.8	54.6	34,201	-1,676	-0.25%	1,216	-356	-354	-54	325
현대차	93,300	1.86	72.3	53.8	77,981	-967	-0.19%	-1,499	3,418	-2,027	-155	-2,970
하나금융지주	27,450	1.48	68.8	52.2	128,038	-4,845	-0.12%	-8,926	-2,610	10,765	8,899	1,974
현대엘리베이	62,400	-0.95	9.2	50.0	11,474	2,219	-0.20%	-703	2,411	-1,708	-200	-1,508
기아차	29,150	1.92	31.0	48.8	61,939	-489	-0.32%	-4,419	-960	5,377	3,358	1,572

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터