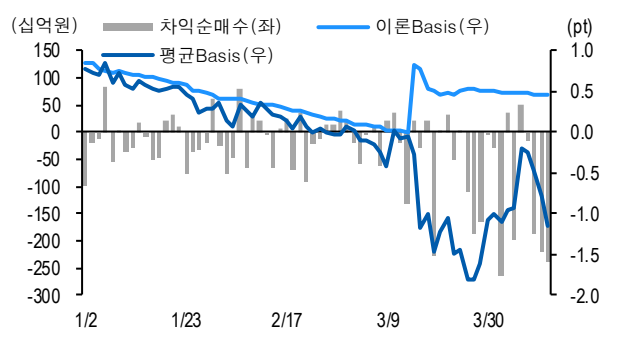
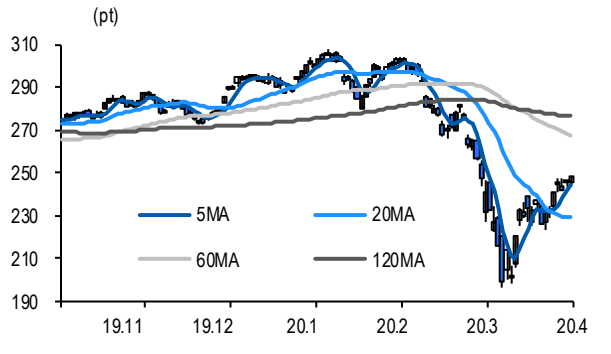




선물옵션시장 지표 2020.4.13

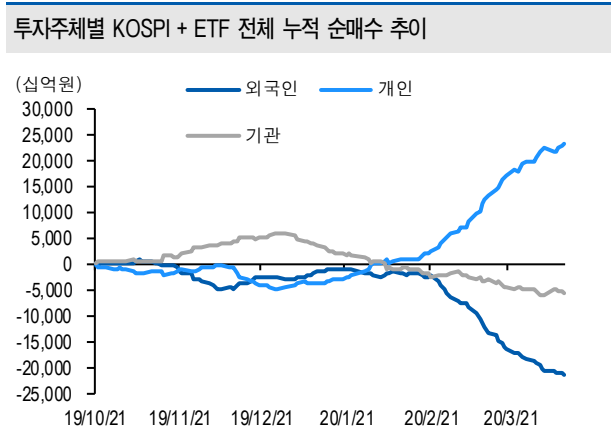
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	248.00	0.97	2.39	7,922.1	-
선물 6월물	247.10	0.84	2.05	15,620.6	318,068
선물 9월물	246.40	0.82	2.00	13.6	6,359
5월물(mini)	247.22	0.91	2.22	1,014.8	63,388
6월물(mini)	247.06	0.82	2.16	69.6	42,891

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.46	-1.14	-0.90	-0.65%	
베이스스(mini)	0.25	-0.86	-0.78	-0.45%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.62	-0.65	-0.19%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.25	-0.75	-0.75	-0.40%	

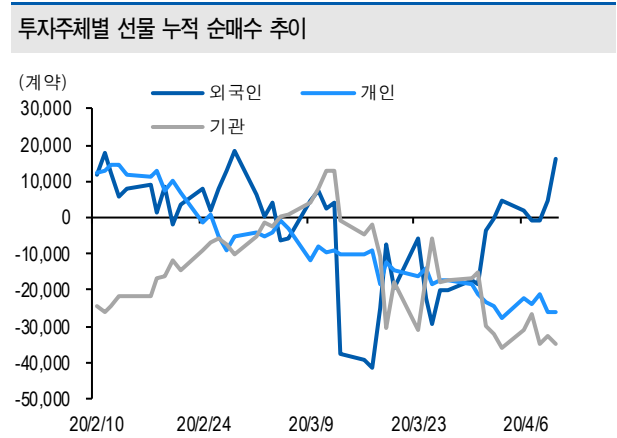


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-55.2	22.4	-32.8	-69.5	-32.9	208.1	-69.9	9.4	7.1	-20.1	
개인	252.4	194.5	446.9	0.0	-2.1	-25.2	-4.9	0.1	0.5	-11.4	
기관	-206.9	-223.7	-430.6	-167.5	-42.1	-184.0	74.5	-5.1	-7.5	29.9	
금융투자	-378.5	-225.7	-604.2	-115.7	-64.6	-47.7	74.3	3.8	-2.4	44.4	
투신	-1.0	-0.4	-1.4	-6.2	-21.2	-120.3	0.2	-9.4	-5.0	-5.6	
은행+보험+기타금융	5.1	-11.9	-6.8	0.0	-5.4	-54.8	0.0	0.6	0.0	-0.4	
연기금+국가자자체	211.0	-21.0	190.0	-43.2	85.7	38.8	-0.1	-0.1	0.0	-8.6	
기타법인	9.8	5.9	15.7	0.0	0.0	1.1	0.4	-4.4	-0.1	1.6	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



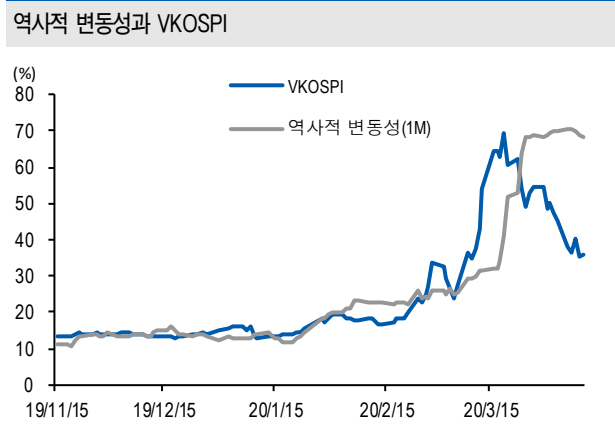


선물옵션시장 지표

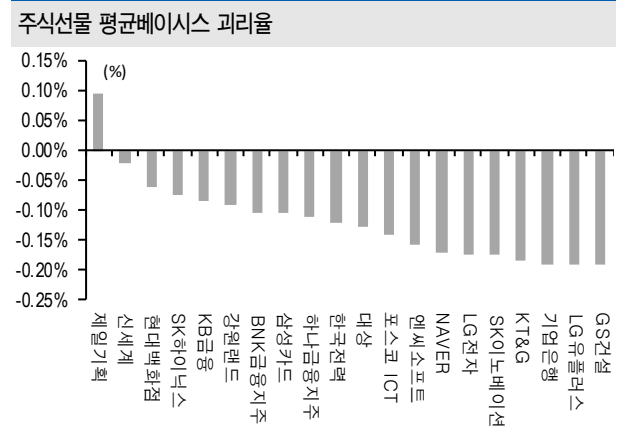
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	513,711	230.0	629,008	27.9%	지수옵션 전체	951,322	474.9	1,364,668
Put	437,611	244.9	735,660	34.8%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	35.84%(+0.29%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	252.5(K+3)	6.56	1.11	12,143	4,735	1,132	27.6	Put	247.5(K+1)	9.52	-0.93	1,161	434	114	32.4
	250.0(K+2)	7.83	0.80	11,256	7,445	1,016	28.2		245.0(K+0)	8.55	-0.52	8,809	4,433	3,300	33.2
	247.5(K+1)	9.24	1.37	5,273	3,539	1,296	29.0		242.5(K-1)	7.69	-0.84	4,571	2,031	427	34.1
	245.0(K+0)	10.80	1.68	3,933	8,795	2,936	29.8		240.0(K-2)	6.90	-0.60	7,427	3,174	1,689	34.9
	242.5(K-1)	12.30	1.25	800	1,711	-9	30.2		237.5(K-3)	6.21	-0.35	5,730	1,900	311	35.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	3,176,950	1,549.3	3,851,435	224,562	-48,805	18,821	29,040	-20.1	-11.4	29.9		

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	-1.76	229.0	74.8	272,284	-4,427	-0.07%	-694	-3,569	4,221	2,585	10,166
LG 이노텍	122,500	-1.61	23.9	58.8	6,072	-113	-1.46%	1,413	248	-1,637	197	377
신세계	240,000	0.63	10.6	58.1	4,009	1,769	-0.02%	-47	-156	202	-545	-955
삼성전자	49,250	0.10	430.2	49.4	1,457,379	23,542	-0.22%	-2,227	5,192	-4,023	27,104	-19,478
호텔신라	74,500	-0.93	19.6	45.1	29,803	-204	-0.31%	-1,481	200	1,276	1,553	543
GS 건설	22,900	4.33	5.8	37.8	18,275	4,715	-0.19%	-2,448	4,669	-2,221	-1,471	-750
POSCO	178,000	8.54	58.6	35.3	28,889	2,758	-0.26%	-995	108	939	867	-1,691
삼성전기	101,500	-0.49	21.9	35.1	35,009	2,947	-1.21%	-3,294	419	2,903	1,085	537
KB 금융	33,700	3.69	36.4	34.6	99,355	15,801	-0.09%	6,054	2,638	-8,742	-9,343	-7,294
하나금융지주	25,350	6.29	25.3	34.3	134,553	510	-0.11%	-1,157	-1,282	2,427	17	2,410

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터