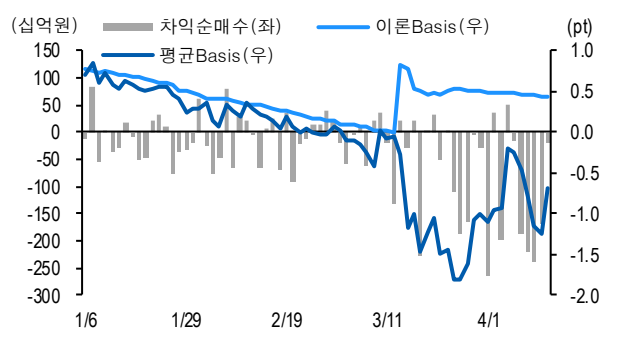
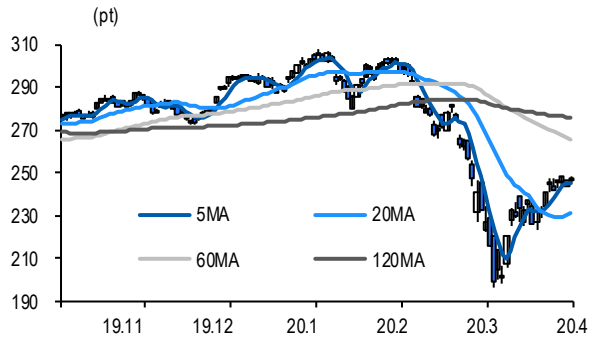




선물옵션시장 지표 2020.4.16

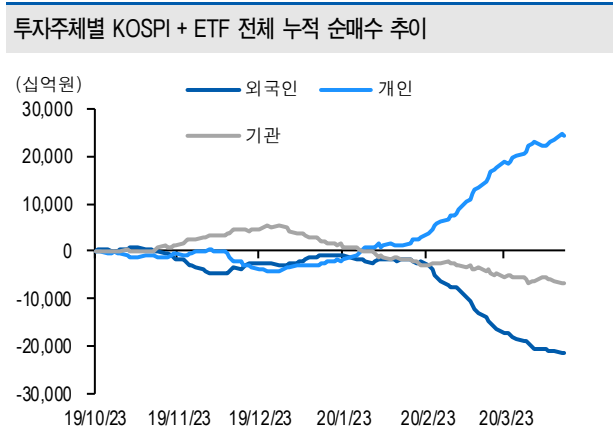
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	247.45	1.66	4.05	6,198.3	-
선물 6월물	246.80	1.98	4.80	18,675.3	324,159
선물 9월물	246.45	1.92	4.65	8.7	6,366
5월물(mini)	247.04	1.87	4.54	1,274.2	66,015
6월물(mini)	247.00	2.07	5.00	83.5	34,453

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.43	-0.68	-0.65	-0.45%	
베이스스(mini)	0.22	-0.30	-0.41	-0.21%	
제1스프레드(SP)	-0.16	-0.61	-0.60	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.22	-0.37	-0.37	-0.24%	

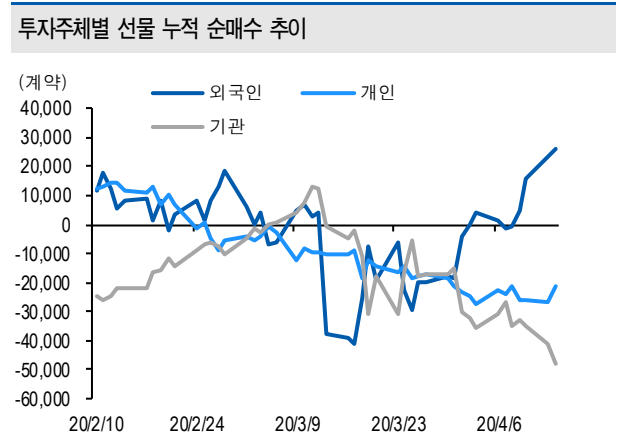


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-14.1	14.3	0.1	-94.4	47.0	38.0	155.5	-2.1	2.5	68.1
개인	-429.7	114.4	-315.3	0.0	-0.7	365.1	-5.5	-0.4	2.7	34.0
기관	426.9	-142.6	284.3	73.9	-22.4	-399.7	-149.7	2.5	-5.3	-103.6
금융투자	145.3	-106.9	38.5	-34.9	-3.9	-314.0	-149.5	2.0	-5.8	-2.3
투신	2.0	26.6	28.6	0.0	-16.1	19.3	-0.2	0.0	-0.1	11.9
은행+보험+기타금융	9.1	-59.4	-50.3	0.0	-9.7	12.5	0.0	0.5	0.5	0.3
연기금+국가자재	241.6	-6.1	235.5	108.8	9.8	-117.6	0.0	0.0	0.0	-113.5
기타법인	16.9	11.3	28.3	0.0	0.0	-3.3	-0.3	0.0	0.1	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





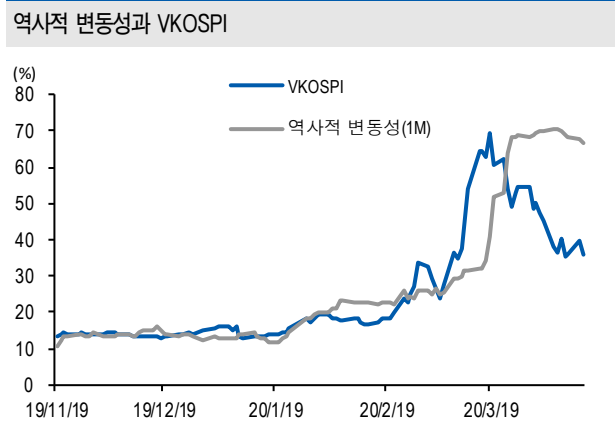
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	443,866	223.5	675,905	28.9%	지수옵션 전체	880,225	463.9	1,487,552
Put	436,359	240.4	811,647	34.8%	PCR(금액기준)	1.08	VKOSPI	36.04%(-3.65%p)

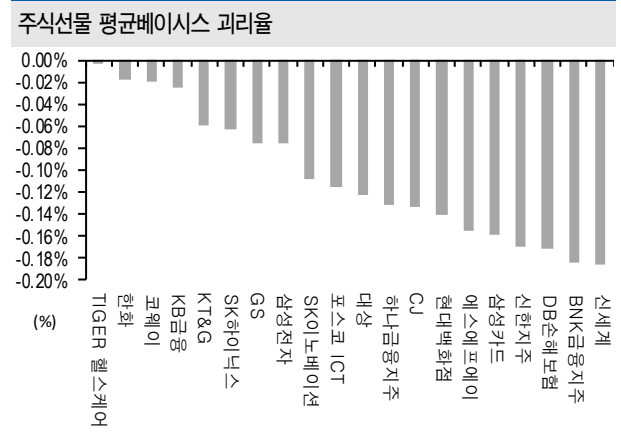
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	250.0(K+3)	7.16	1.20	6,310	8,199	62	28.6	Put	245.0(K+1)	7.98	-2.92	5,452	5,685	1,042	32.4
	247.5(K+2)	8.55	1.45	5,468	4,528	488	29.4		242.5(K+0)	7.12	-2.72	6,373	2,750	28	33.3
	245.0(K+1)	10.10	1.71	2,558	9,219	265	30.4		240.0(K-1)	6.29	-2.60	5,639	4,049	406	34.1
	242.5(K+0)	11.70	1.87	775	2,550	80	31.2		237.5(K-2)	5.67	-2.24	5,944	3,029	291	35.3
	240.0(K-1)	13.45	2.15	1,116	3,036	599	32.2		235.0(K-3)	5.04	-2.20	13,149	7,088	-828	36.2

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	2,370,138	1,346.2	4,079,107	212,944	136,782	43,154	-182,018	68.1	34.0	-103.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	49,000	1.66	434.6	63.0	1,461,991	41,121	-0.08%	34,753	19,705	-54,670	4,784	-71,656
SK 하이닉스	82,300	1.11	171.3	62.6	265,964	16,683	-0.06%	5,845	627	-6,884	8,497	-20,918
호텔신라	72,800	1.25	18.2	54.7	25,432	-3,660	-0.78%	3,194	498	-3,694	-48	-194
KB 금융	33,200	1.84	24.4	46.6	103,989	4,253	-0.02%	3,138	2,300	-5,588	-632	-10,964
신세계	233,000	0.22	6.4	46.0	2,546	-861	-0.19%	216	149	-365	-1	78
카카오	159,500	1.59	30.3	44.1	25,943	2,485	-0.25%	738	2,187	-2,925	695	-3,305
POSCO	183,000	0.83	47.6	42.9	28,069	937	-0.23%	1,171	547	-1,923	657	-2,213
삼성 SDI	251,000	5.46	64.8	40.5	9,654	3,056	-0.46%	1,478	1,935	-3,497	303	-4,000
삼성전기	101,000	2.54	24.5	39.6	39,541	315	-0.66%	1,838	2,233	-4,147	-2,930	-1,796
KODEX 삼성그룹	6,030	0.92	0.4	35.3	231	0	-1.79%	0	0	0	0	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

