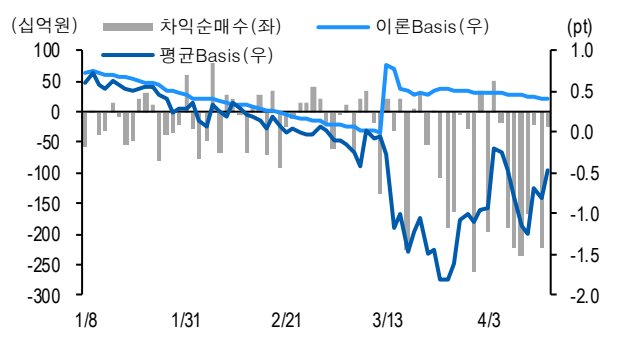
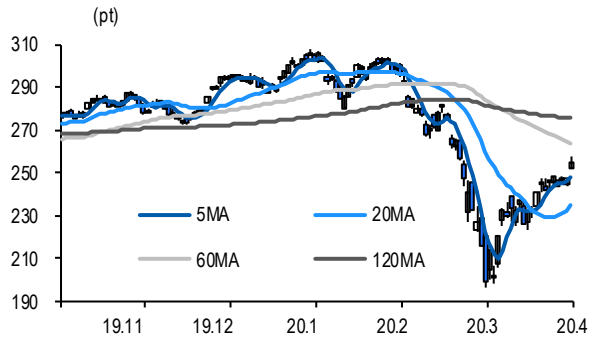




선물옵션시장 지표 2020.4.20

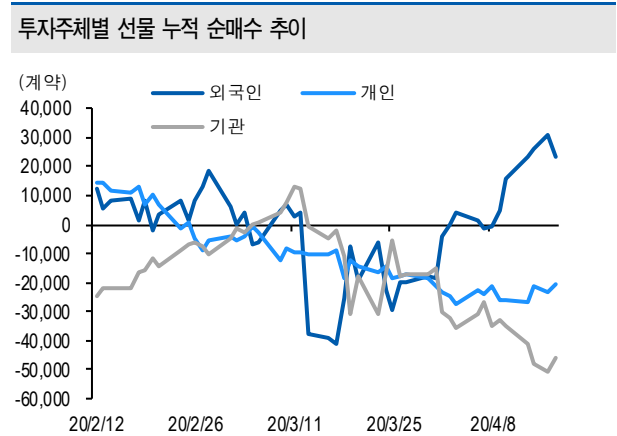
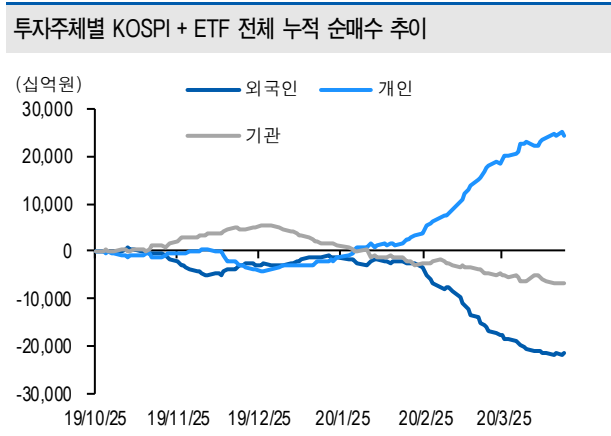
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	255.02	3.21	7.92	8,845.5	-
선물 6월물	254.75	3.05	7.55	22,346.3	324,995
선물 9월물	253.85	3.17	7.80	15.0	6,430
5월물(mini)	254.92	3.00	7.42	1,387.7	64,813
6월물(mini)	254.60	2.99	7.68	77.1	32,813

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.42	-0.46	-0.27	-0.35%	
베이스(mini)	0.21	-0.16	-0.10	-0.14%	
제1스프레드(SP)	-0.14	-0.61	-0.65	-0.19%	
합성선물 베이스(ATM)	0.21	-0.06	-0.06	-0.10%	



투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	318.6	245.5	564.1	0.0	191.0	-467.1	-15.6	3.9	0.5	16.1
개인	-605.7	103.4	-502.3	0.0	0.5	167.5	12.2	-0.2	-2.5	32.4
기관	235.6	-350.9	-115.3	-22.6	-27.4	304.7	4.0	-4.1	2.3	-49.8
금융투자	110.9	-224.9	-114.0	-2.6	1.4	42.0	3.9	-3.9	2.3	-44.4
투신	32.0	-22.6	9.4	1.3	-0.4	205.6	0.2	0.0	0.0	58.7
은행+보험+기타금융	-33.1	-106.3	-139.4	0.0	-44.7	39.6	0.0	-0.2	0.1	-2.3
연기금+국가지자체	86.5	9.5	96.1	-21.3	28.1	17.5	-0.1	0.0	0.0	-61.7
기타법인	51.5	1.5	53.0	0.0	0.0	-5.1	-0.6	0.3	-0.2	1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



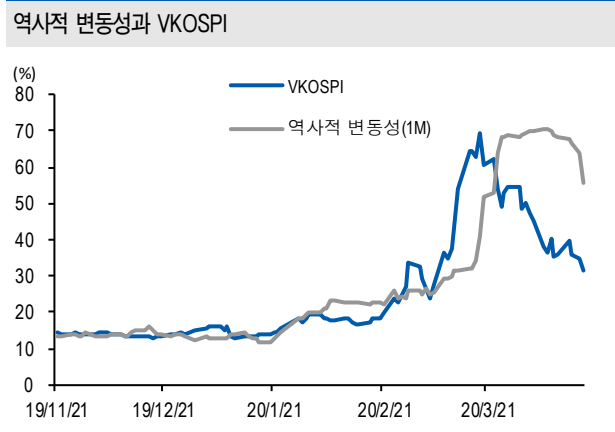
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	907,205	391.1	746,884	26.8%	지수옵션 전체	1,710,053	715.0	1,656,613
Put	802,848	323.9	909,729	31.7%	PCR(금액기준)	0.83	VKOSPI	31.44%(-3.38%p)

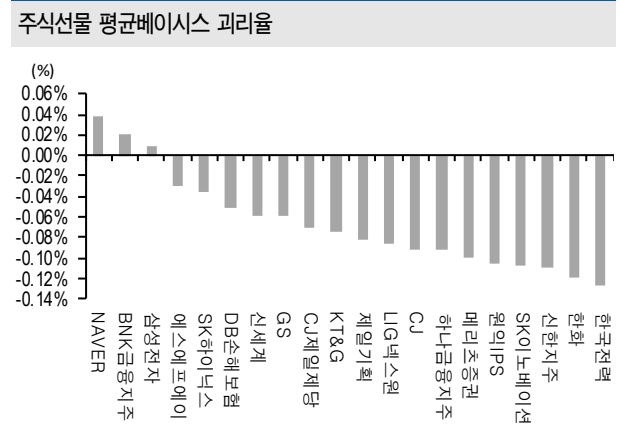
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	255.0(K+3)	7.55	2.97	7,378	5,631	-298	26.4	Put	250.0(K+1)	5.77	-3.63	9,742	5,023	1,532	29.1
	252.5(K+2)	9.08	3.41	5,119	5,373	54	27.3		247.5(K+0)	5.04	-3.24	10,846	2,461	1,142	30.1
	250.0(K+1)	10.75	3.82	2,790	8,297	-129	28.2		245.0(K-1)	4.39	-2.95	15,531	6,687	501	31.0
	247.5(K+0)	12.50	4.16	2,481	4,838	-234	29.0		242.5(K-2)	3.85	-2.64	13,762	3,883	986	32.0
	245.0(K-1)	14.35	4.50	1,080	9,329	-143	29.9		240.0(K-3)	3.37	-2.37	34,672	6,704	2,140	33.0

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	3,606,621	2,275.1	4,437,762	246,469	28,393	46,720	-76,814	16.1	32.4	-49.8		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	84,000	2.82	345.2	65.7	288,462	26,768	-0.04%	1,141	16,139	-18,209	-25,547	-12,866
삼성전자	51,500	4.78	705.1	43.0	1,552,485	72,561	0.01%	20,053	14,008	-33,343	10,247	-73,531
삼성 SDI	285,500	4.96	242.9	39.7	13,024	-1,030	-0.17%	-457	695	-299	-1,438	749
LG 화학	362,000	5.08	105.9	38.5	9,800	-1,163	-0.24%	-227	-115	321	-1,827	1,957
신세계	252,000	7.23	18.8	36.5	3,464	955	-0.06%	-138	-109	249	-525	-254
호텔신라	76,900	4.91	47.0	35.7	25,939	-617	-0.37%	1,145	107	-1,244	-1,515	-886
삼성전기	114,000	8.06	97.2	35.1	52,774	8,965	-0.18%	-3,372	2,029	1,150	3,021	-4,589
대림산업	78,500	4.39	19.6	35.0	11,438	1,099	-0.20%	-605	1,225	-606	531	-1,193
카카오	171,500	3.31	54.9	33.9	27,464	-2,729	-0.25%	-311	-1,811	2,107	-1,786	3,425
KB 금융	32,350	1.57	29.0	28.5	114,625	4,831	-0.17%	-8,907	4,001	5,008	2,595	3,279

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터