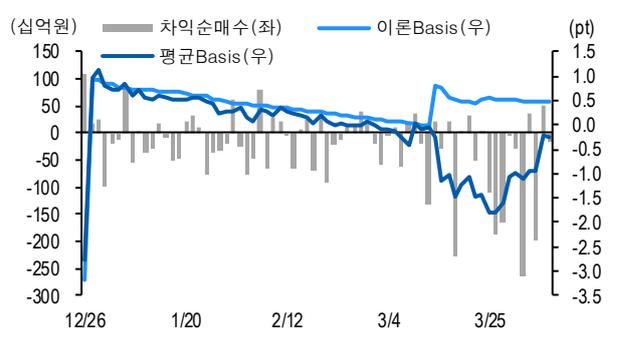
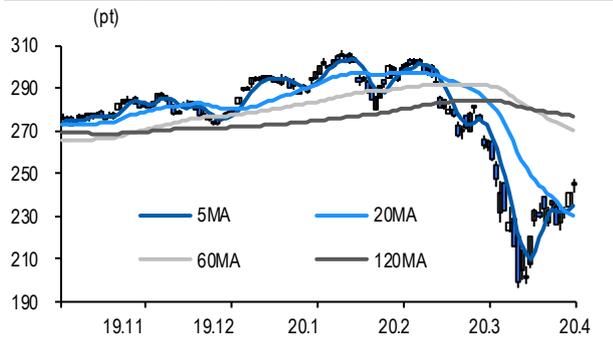




선물옵션시장 지표 2020.4.8

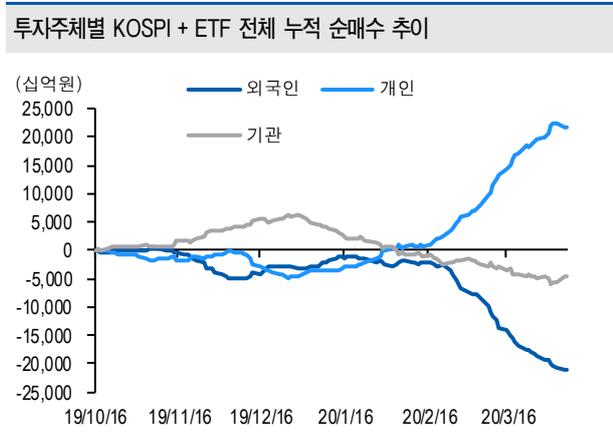
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	244.87	1.69	4.06	7,848.3	-
선물 6월물	245.25	1.89	4.55	28,674.3	330,769
선물 9월물	244.65	2.04	4.90	16.8	6,280
4월물(mini)	245.32	1.96	4.72	2,026.9	143,220
5월물(mini)	245.18	1.83	4.40	89.8	21,613

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스스	0.48	-0.25	0.38	-0.30%	
베이스스(mini)	0.01	0.00	0.45	-0.01%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.53	-0.50	-0.15%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.55	0.55	0.22%	

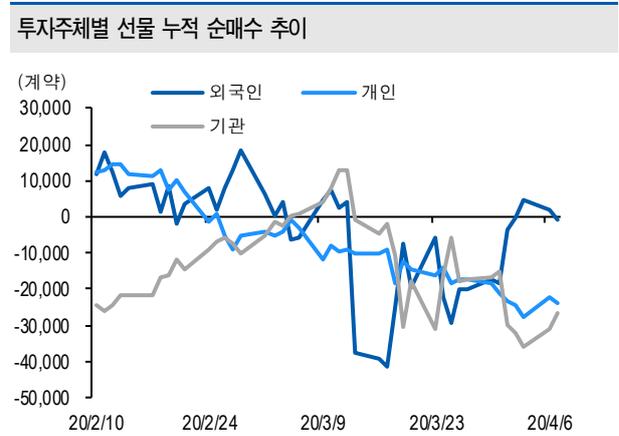


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-196.3	12.3	-184.0	0.0	-247.9	-172.5	10.5	0.7	0.4	27.3	
개인	150.5	17.7	168.3	0.0	-1.5	-78.3	-0.3	-3.2	-1.6	-33.3	
기관	35.2	-39.7	-4.6	-16.0	-48.5	259.1	-10.3	2.2	1.7	6.6	
금융투자	48.4	-49.2	-0.8	3.6	3.7	195.2	-10.6	2.0	2.6	4.4	
투신	41.7	0.5	42.1	0.0	-21.3	30.5	0.3	0.3	-0.2	-10.5	
은행+보험+기타금융	-10.1	3.8	-6.3	0.0	-22.4	8.3	0.0	-0.2	-0.7	-0.4	
연기금+국가자재	-17.7	0.4	-17.3	-19.6	-3.3	25.1	0.0	0.0	0.0	13.1	
기타법인	10.6	8.6	19.2	0.0	0.5	-8.3	0.1	0.3	-0.4	-0.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

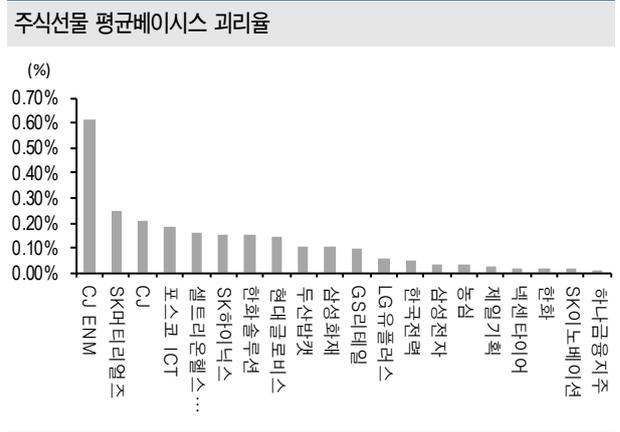
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	1,957,641	498.1	1,310,741	40.5%	지수옵션 전체	3,798,107	986.8	2,543,942		
Put	1,840,466	488.7	1,233,201	46.6%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	36.14%(-2.12%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	247.5(K+3)	2.42	0.69	140,876	18,728	1,165	40.1	Put	242.5(K+1)	2.43	-2.91	63,028	7,936	3,820	39.7
	245.0(K+2)	3.65	1.12	76,584	16,271	-1,141	41.8		240.0(K+0)	1.75	-2.43	120,630	15,620	1,899	42.1
	242.5(K+1)	5.30	1.73	30,248	7,868	-1,976	45.3		237.5(K-1)	1.25	-2.02	119,406	10,572	3,697	44.4
	240.0(K+0)	7.17	2.27	9,623	10,141	-1,944	48.9		235.0(K-2)	0.91	-1.64	144,851	13,040	5,313	47.1
	237.5(K-1)	9.21	2.73	3,004	6,187	-887	52.7		232.5(K-3)	0.65	-1.32	152,901	12,486	1,547	49.4

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	4,698,379	2,759.7	5,345,245	-80,984	21,438	-47,247	25,309	27.3	-33.3	6.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	161,000	0.00	94.5	64.4	44,245	-16,518	0.00%	14,884	-1,107	-13,982	-3,873	-9,363
SK 하이닉스	86,300	3.60	303.3	63.2	254,813	9,345	0.15%	1,460	-3,129	1,925	-2,400	-13,057
삼성전자	49,700	1.84	917.5	59.1	1,416,550	-336,422	0.03%	16,242	3,480	-19,089	-3,233	38,177
호텔신라	73,200	4.42	44.9	55.4	20,477	-8,033	-0.11%	736	-2,646	1,937	-1,719	3,420
GS 건설	20,700	1.72	7.9	49.1	21,033	-9,506	-0.38%	1,932	-10,377	8,569	8,773	2,950
LG 이노텍	128,500	5.33	32.1	44.2	11,692	1,770	-0.04%	-858	-828	1,692	2,471	-2,005
KB 금융	33,200	0.91	32.2	37.9	85,684	-7,408	0.00%	2,368	-1,477	-892	-3,314	3,590
LG 전자	54,500	6.65	41.8	37.3	44,060	4,764	-0.09%	-1,720	10,497	-8,743	-2,953	-5,094
하나금융지주	24,500	2.94	20.3	36.2	103,340	-7,643	0.01%	-1,530	-4,822	5,774	8,697	-2,593
삼성 SDI	245,500	1.87	95.5	35.2	13,815	-981	-0.02%	408	-38	-419	-1,518	563

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터