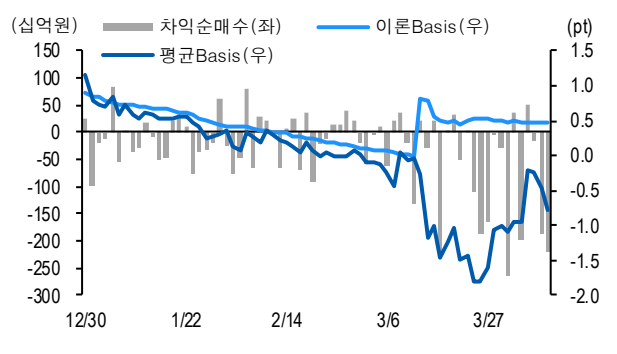
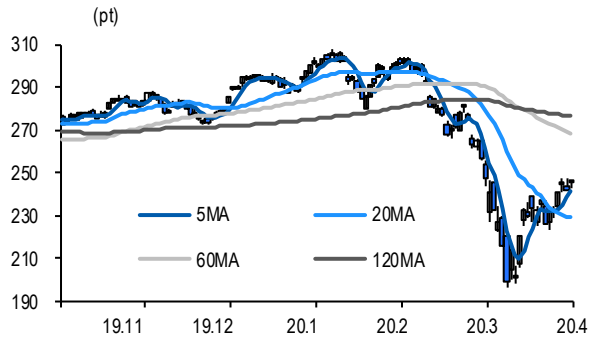




선물옵션시장 지표 2020.4.10

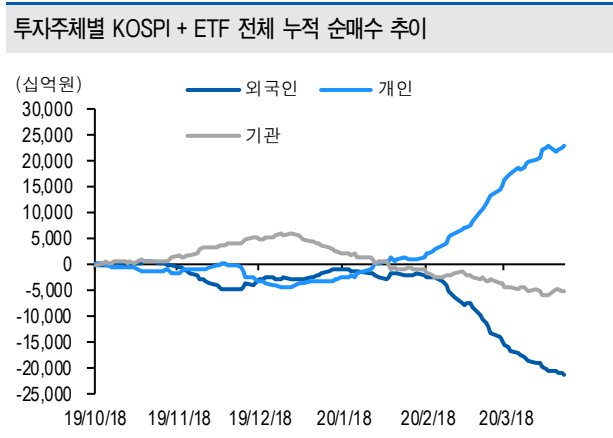
Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	245.61	1.54	3.72	6,166.9	-
선물 6월물	245.05	1.47	3.55	24,466.9	319,022
선물 9월물	244.40	1.54	3.70	18.8	6,360
4월물(mini)	245.92	1.66	4.02	1,131.5	144,430
5월물(mini)	245.00	1.39	3.36	619.8	49,547

차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.47	-0.78	-0.56	-0.51%	
베이스(mini)	0.00	-0.07	0.31	-0.03%	
제1스프레드(SP)	-0.17	-0.65	-0.60	-0.20%	
합성선물 베이스(ATM)	0.00	0.30	0.30	0.12%	

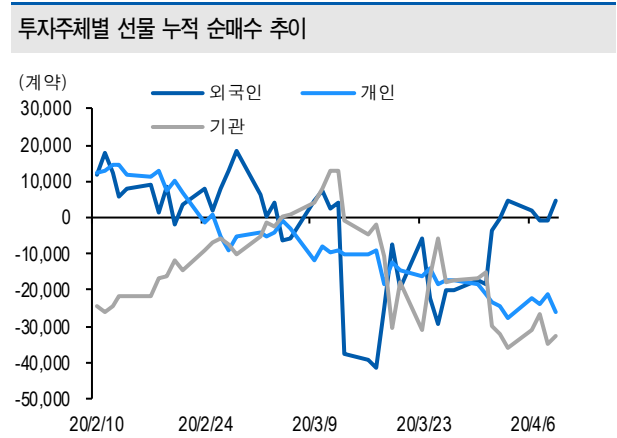


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-183.1	-53.4	-236.5	-86.9	-216.0	152.4	187.2	-8.1	0.0	-17.6
개인	298.4	95.3	393.8	0.0	-0.5	-290.6	3.7	8.3	4.8	-15.0
기관	-130.0	-39.9	-169.9	-134.7	55.1	139.6	-191.8	-0.6	-4.6	33.5
금융투자	-219.5	-98.4	-317.8	-148.1	88.0	283.0	-194.4	2.2	-4.4	72.2
투신	169.5	-10.9	158.7	0.0	5.3	-36.4	2.7	-2.8	-0.7	-91.2
은행+보험+기타금융	-7.1	55.1	47.9	0.0	-9.3	-95.8	0.0	0.4	0.3	-2.8
연기금+국가자재	-67.7	-8.8	-76.5	13.4	-0.1	-11.2	0.0	-0.4	0.1	55.3
기타법인	14.6	-0.3	14.3	0.0	0.0	-1.4	0.9	0.5	-0.2	-0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





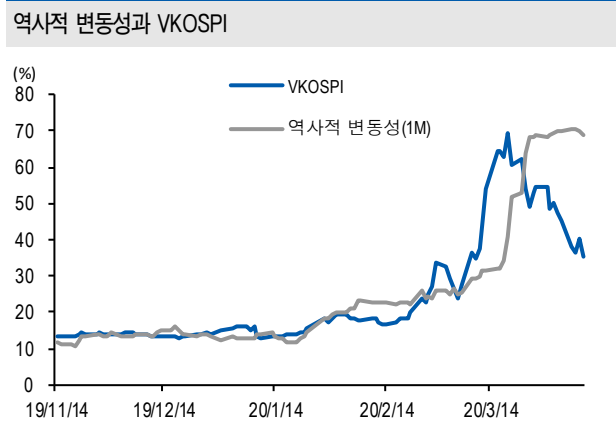
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,257,276	392.1	1,441,942	15.9%	지수옵션 전체	4,409,139	764.3	2,827,522
Put	2,151,863	372.3	1,385,580	21.3%	PCR(금액기준)	0.95	VKOSPI	35.55%(-4.50%p)

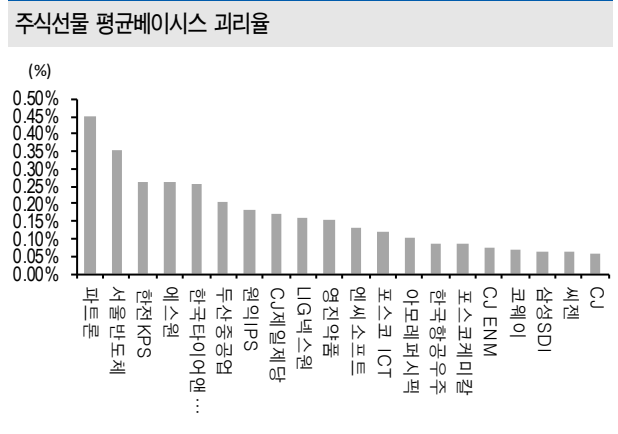
  

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	250.0(K+3)	0.01	-0.37	416,912	28,816	3,744	15.4	Put	245.0(K+1)	0.25	-4.22	280,628	25,933	11,256	9.7
	247.5(K+2)	0.07	-0.68	501,920	27,846	4,999	11.4		242.5(K+0)	0.04	-2.98	452,381	19,343	8,731	14.9
	245.0(K+1)	0.95	-0.46	396,743	29,032	6,055	11.5		240.0(K-1)	0.02	-2.00	422,025	24,170	5,543	21.5
	242.5(K+0)	3.45	0.95	142,286	14,926	3,663	26.7		237.5(K-2)	0.01	-1.28	257,605	17,825	6,350	27.0
	240.0(K-1)	5.84	1.86	13,135	7,845	-1,239	35.2		235.0(K-3)	0.01	-0.79	225,436	22,712	6,184	34.4

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	3,513,126	1,914.4	5,075,904	-107,452	-4,182	-12,320	16,088	-17.6	-15.0	33.5		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오	158,500	-0.63	62.7	54.6	28,689	-22,241	-0.03%	-4,628	-475	5,102	-3,218	10,080
SK 하이닉스	85,000	0.35	87.8	29.1	53,180	-125,851	-0.01%	-2,149	-7,953	10,087	-3,485	4,241
삼성전자	49,200	1.34	273.3	24.7	194,037	-575,716	-0.07%	-8,339	-1,668	10,387	153,088	30,053
대한항공	19,800	4.49	10.9	20.8	31,270	-45,472	-0.03%	5,291	-3,462	-1,820	9,516	-3,306
하이트진로	29,200	-0.68	2.7	19.2	2,472	-6,634	-0.19%	873	-914	91	650	-22
LG 이노텍	124,000	-1.98	7.7	18.1	3,966	-4,003	0.05%	-163	326	-176	-2,037	2,515
삼성증권	28,150	2.36	2.5	16.0	3,941	-6,494	-0.47%	2,532	357	-2,899	3,061	1,823
호텔신라	75,300	2.31	7.2	14.6	10,100	-6,657	0.03%	688	-1,817	1,128	-274	1,195
아모레퍼시픽	169,500	-1.17	8.3	13.3	8,530	-4,129	0.10%	78	-150	122	893	-109
LG 전자	53,500	1.33	6.1	12.3	17,156	-15,153	-0.02%	-63	-256	321	1,415	936

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터