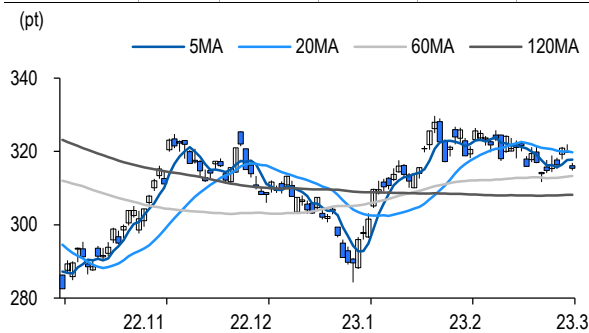


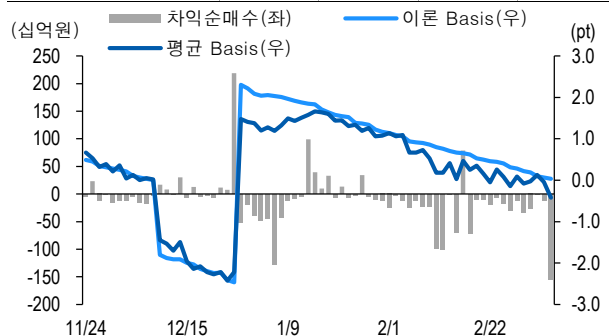
선물옵션시장 지표

2023.3.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.38	-1.38	-4.42	7,031.4	-
선물 3월물	314.65	-1.49	-4.75	15,783.7	118,144
선물 6월물	315.70	-1.64	-5.25	5,211.3	256,750
3월물(mini)	314.88	-1.42	-4.52	1,157.8	53,451
4월물(mini)	314.68	-1.45	-4.62	129.2	23,458



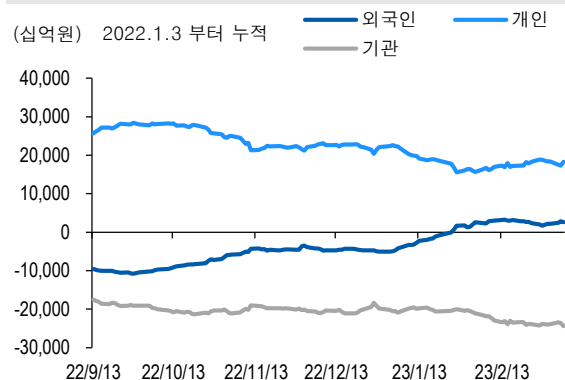
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.03	-0.42	-0.73	-0.14%
베이스스(mini)	0.03	-0.42	-0.50	-0.14%
제1스프레드(SP)	2.02	1.45	1.40	-0.18%
합성선물 베이스스(ATM)	0.03	-0.69	-0.69	-0.23%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-154.8	-15.7	-170.4	0.0	-263.2	-351.5	-42.7	-1.9	5.1	-38.0
개인	943.1	-15.9	927.1	0.0	1.1	274.7	30.0	-0.7	-1.9	78.7
기관	-820.1	25.4	-794.7	-154.5	-82.9	40.8	12.0	3.7	-2.6	-41.4
금융투자	-771.7	-51.5	-823.1	-127.0	-74.4	482.8	12.0	2.7	-1.5	-54.3
투신	-17.1	14.9	-2.3	0.0	-9.3	-383.0	0.3	-0.2	0.0	5.4
은행+보험+기타금융	8.7	1.5	10.2	0.0	0.8	-54.6	-0.3	1.3	-1.1	0.2
연기금+국가지자체	19.1	24.2	43.4	0.0	9.0	-4.5	0.0	0.0	0.0	7.4
기타법인	31.9	6.3	38.2	0.0	0.8	36.0	0.8	-1.1	-0.6	0.6

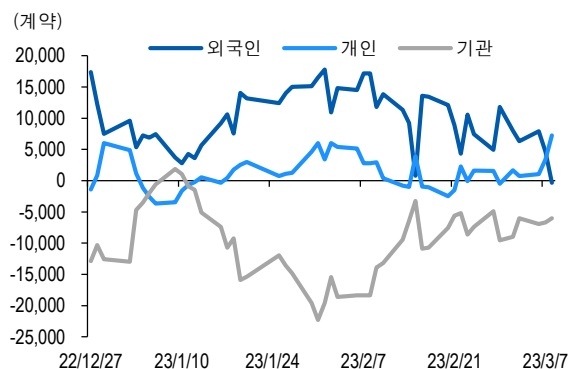
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



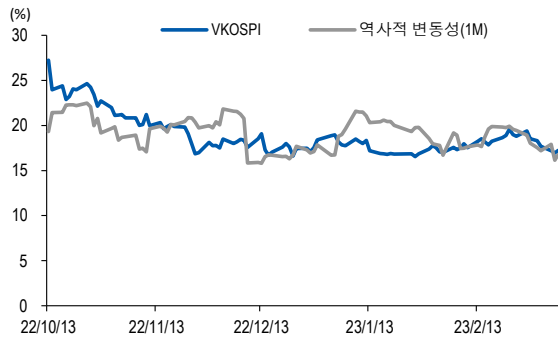
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,378,187	216.9	1,188,140	12.5%	지수옵션 전체	2,576,381	499.7	2,875,438
Put	1,198,194	282.8	1,687,298	17.8%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	17.21%(+0.26%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	0.01	-0.05	62,836	46,314	6,018	20.3	Put	322.5(K+1)	7.93	4.18	3,292	10,385	-342	34.6
	325.0(K+2)	0.01	-0.23	98,487	32,418	-4,683	16.6		320.0(K+0)	5.38	3.22	21,752	23,136	-1,550	26.2
	322.5(K+1)	0.03	-0.65	176,812	39,164	7,937	14.9		317.5(K-1)	3.12	2.05	86,389	20,541	-4,099	20.5
	320.0(K+0)	0.07	-1.52	329,058	46,676	17,172	12.3		315.0(K-2)	1.46	0.99	294,157	31,550	-5,677	18.0
	317.5(K-1)	0.33	-2.65	383,429	38,416	16,565	11.3		312.5(K-3)	0.53	0.36	319,224	35,069	568	17.1

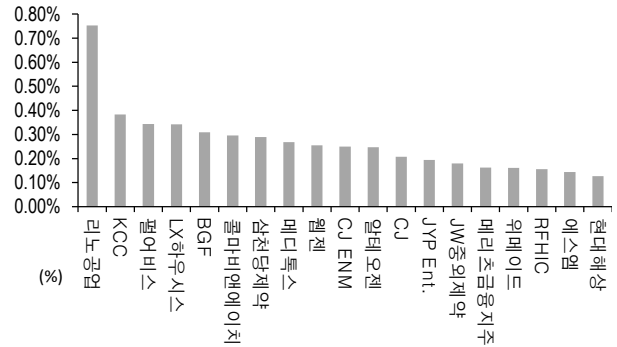
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



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	3,621,783	2,911.1	4,827,656	100,324	-26,070	111,846	-84,863	-38.0	78.7	-41.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	175,000	-0.11	63.3	73.9	11,791	-9,979	0.01%	139	858	-1,003	-1,845	-100
삼성전자	60,400	-0.66	426.5	51.0	379,689	-142,613	-0.02%	-2,740	57,944	-55,209	-53,924	2,000
SK 하이닉스	86,800	-2.25	121.5	50.6	70,341	-27,006	0.02%	-5,119	12,893	-7,754	-3,588	-1,744
한국조선해양	78,100	-1.14	9.4	50.2	6,181	-2,521	0.06%	-3,287	5,680	-2,510	-2,071	-439
LG 전자	117,800	2.70	100.7	49.6	33,096	-2,329	0.10%	4,345	1,706	-5,954	-4,291	-661
삼성전기	152,100	0.60	20.5	44.8	8,108	-940	-0.17%	-598	-981	1,583	293	-213
LG 디스플레이	15,160	-0.72	5.8	44.2	48,865	-8,956	0.07%	4,701	1,977	-6,678	-7,459	780
LG 화학	713,000	-3.78	65.7	42.1	4,281	-1,853	-0.01%	-857	541	315	-44	251
롯데케미칼	179,900	-3.07	7.4	41.9	3,862	-1,989	-0.01%	-361	-366	747	585	162
카카오페이	59,600	-3.40	17.5	41.2	32,895	-7,875	-0.24%	-1,083	-2,479	3,562	-2,012	-151

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터