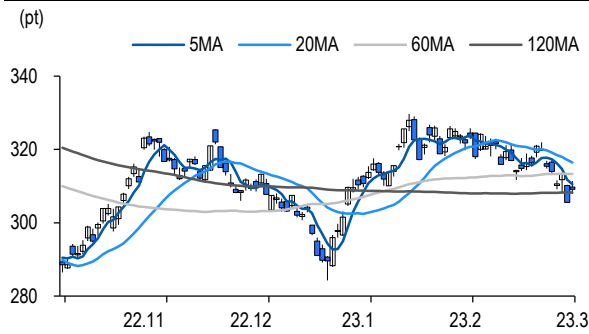


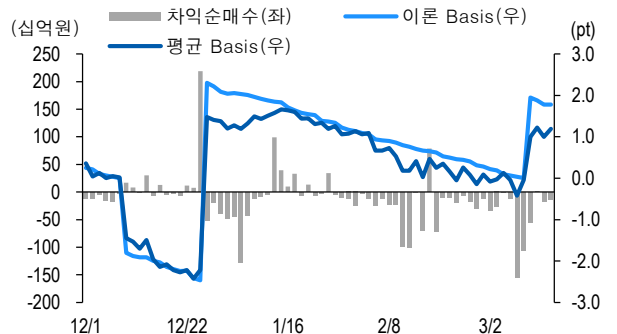
선물옵션시장 지표

2023.3.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.10	1.15	3.52	5,395.9	-
선물 6월물	310.10	1.04	3.20	21,665.2	318,410
선물 9월물	311.70	1.17	3.60	16.6	19,950
4월물(mini)	308.82	1.00	3.06	1,716.2	65,182
5월물(mini)	309.70	1.19	3.64	5.5	2,922

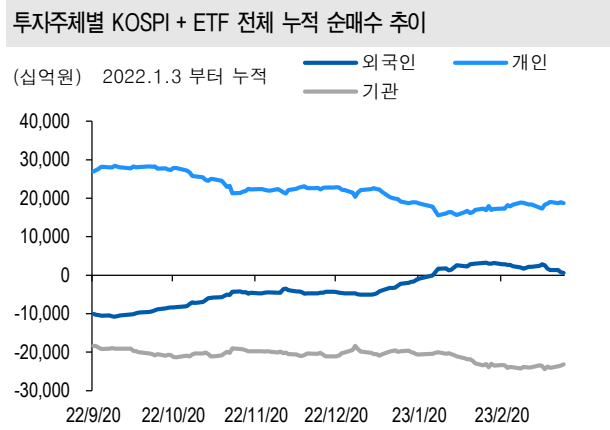


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.78	1.19	1.00	-0.19%
베이스스(mini)	0.07	-0.05	-0.28	-0.04%
제1스프레드(SP)	1.91	1.35	1.40	-0.18%
합성선물 베이스스(ATM)	0.07	-0.30	-0.30	-0.12%

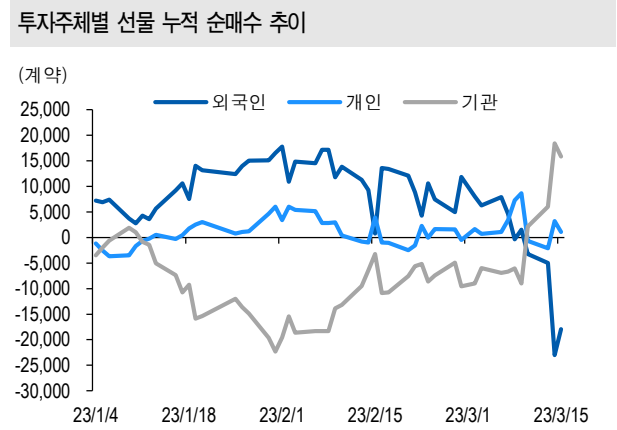


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-80.8	-29.7	-110.5	0.2	7.7	548.5	-154.7	6.6	-2.1	35.3
개인	-247.6	-29.4	-276.9	0.0	0.7	-155.3	-11.8	-4.5	-0.6	-14.8
기관	293.4	54.1	347.5	-13.3	-14.2	-364.5	165.1	-1.6	3.0	-13.2
금융투자	248.8	114.2	363.0	-8.1	-4.3	-893.4	161.1	-4.0	5.5	-19.1
투신	26.5	-25.6	0.9	0.0	2.2	566.4	3.9	-0.1	0.0	1.1
은행+보험+기타금융	29.4	-22.8	6.6	0.0	-3.8	-23.4	0.0	2.2	-2.2	0.0
연기금+국가지자체	23.1	-28.5	-5.4	0.0	-3.9	-14.1	0.0	0.2	-0.3	4.8
기타법인	34.9	-0.9	34.0	0.0	-0.3	-28.7	1.5	-0.5	-0.3	-7.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

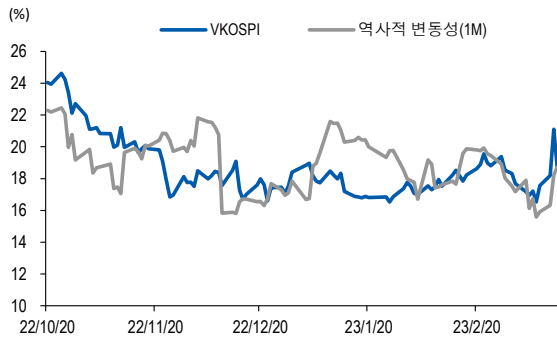
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	538,886	206.4	759,186	16.6%	지수옵션 전체	1,056,831	398.9	1,870,393
Put	517,945	192.5	1,111,207	18.9%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	18.75%(-2.36%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	4.39	0.46	9,400	4,386	637	16.6	Put	307.5(K+1)	5.58	-2.18	6,113	7,706	406	18.2
	310.0(K+2)	5.55	0.62	12,622	7,559	1,293	16.8		305.0(K+0)	4.57	-1.99	15,182	13,034	-72	18.4
	307.5(K+1)	6.86	0.80	2,696	2,646	368	17.0		302.5(K-1)	3.73	-1.81	14,841	16,408	543	18.7
	305.0(K+0)	8.37	1.00	966	1,555	321	17.3		300.0(K-2)	2.98	-1.61	43,454	25,399	1,285	18.9
	302.5(K-1)	10.15	1.35	164	517	38	17.9		297.5(K-3)	2.38	-1.47	34,025	12,922	544	19.2

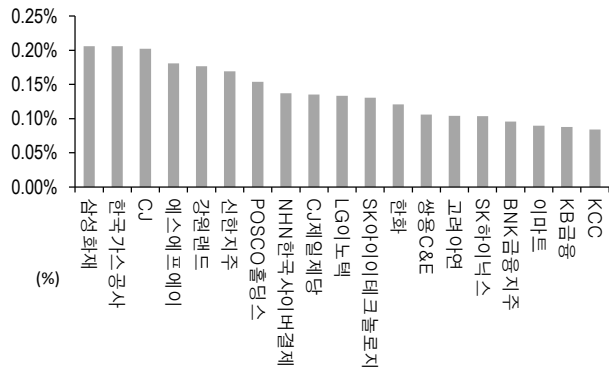
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,144,063	2,318.4	4,106,987	26,306	31,728	-34,180	15,954	35.3	-14.8	-13.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메리츠증권	6,500	2.04	5.2	145.2	74,261	3,957	-0.20%	-11,710	4,544	7,166	7,166	0
넷마블	56,400	-0.88	9.4	90.4	7,050	683	-0.12%	574	-355	-219	-56	-159
현대차	175,000	2.10	73.4	87.7	31,042	271	-0.04%	949	255	-1,187	-1,562	695
영진약품	2,905	4.50	0.7	72.7	10,561	1,729	-0.14%	2,242	9	-2,251	-2,251	0
삼성전자	59,600	1.19	414.9	67.2	1,096,691	-14,359	-0.05%	8,703	-5,634	11,919	11,517	1,100
LG 화학	722,000	1.98	70.2	63.6	8,212	-179	-0.03%	133	-42	-90	180	75
LG 디스플레이	14,130	-0.84	9.1	58.6	31,424	-7,223	-0.21%	272	-1,064	822	5,597	1,590
CJ	95,400	1.49	3.6	56.6	22,201	2,283	0.20%	-564	2,217	-1,653	-1,656	3
삼성 SDI	735,000	2.23	98.4	56.5	13,224	55	-0.07%	-284	92	190	199	4
현대제철	33,400	0.75	8.3	55.3	14,714	3,587	-0.03%	162	-1,105	943	1,284	-329

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터