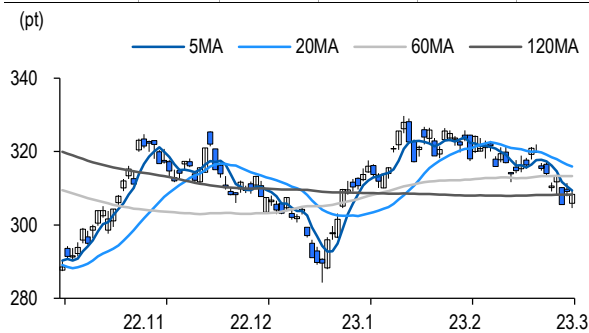


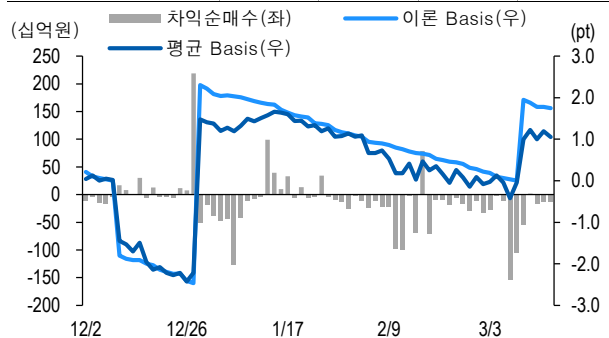
선물옵션시장 지표

2023.3.17

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	308.39	-0.23	-0.71	6,047.5	-
선물 6월물	309.60	-0.16	-0.50	23,188.1	311,281
선물 9월물	310.80	-0.29	-0.90	12.7	19,954
4월물(mini)	308.36	-0.15	-0.46	1,849.1	64,442
5월물(mini)	308.76	-0.30	-0.94	3.0	7,191



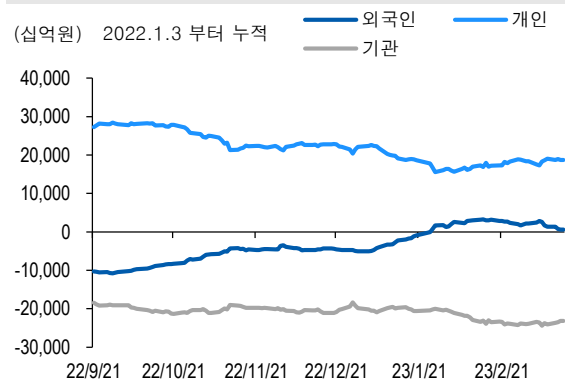
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.75	1.05	1.21	-0.23%
베이스(mini)	0.04	-0.17	-0.03	-0.07%
제1스프레드(SP)	1.90	1.33	1.35	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	0.04	0.08	0.08	0.01%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-86.6	27.6	-59.0	0.1	43.3	180.5	52.3	-7.1	4.8	-12.6
개인	69.1	-64.2	4.9	0.0	0.6	-215.3	-15.5	7.2	0.3	10.8
기관	-3.8	-43.8	-47.7	-12.6	-0.5	57.7	-36.9	-0.1	-5.0	-0.4
금융투자	-132.3	31.3	-101.1	-6.1	-6.1	-376.0	-34.3	-0.1	-4.7	0.5
투신	26.6	-19.4	7.2	-0.1	3.9	425.0	-2.7	0.0	0.0	-1.7
은행+보험+기타금융	5.8	-65.1	-59.3	0.0	-1.0	0.6	0.0	0.1	-0.3	0.3
연기금+국가자재	71.3	1.7	73.0	0.0	12.3	8.0	0.0	0.0	0.0	0.5
기타법인	21.3	0.3	21.6	0.0	-1.2	-23.0	0.1	-0.1	-0.2	2.2

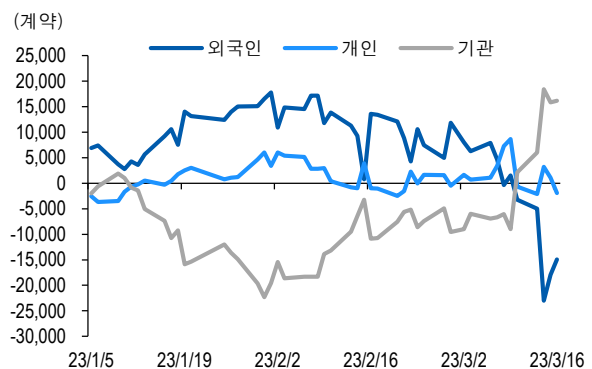
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



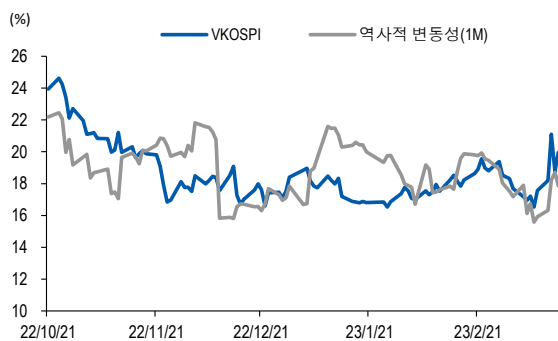
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	601,590		226.9		790,627		17.4%		지수옵션 전체	1,265,585		505.2		1,952,201	
Put	663,995		278.3		1,161,574		19.2%		PCR(금액기준)	1.23		VKOSPI		19.97%(+1.22%p)	

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	2.59	0.03	62,601	13,504	2,007	17.3	Put	312.5(K+1)	8.60	0.51	548	3,572	59	18.3
	315.0(K+2)	3.40	0.01	41,514	13,676	1,741	17.5		310.0(K+0)	7.15	0.37	6,021	13,999	602	18.3
	312.5(K+1)	4.41	0.02	18,867	5,613	1,227	17.9		307.5(K-1)	5.97	0.39	11,012	9,626	1,920	18.6
	310.0(K+0)	5.62	0.07	22,284	14,127	6,568	18.3		305.0(K-2)	4.95	0.38	14,892	13,183	149	19.0
	307.5(K-1)	6.86	0.00	6,813	4,182	1,536	18.4		302.5(K-3)	4.08	0.35	16,220	16,935	527	19.4

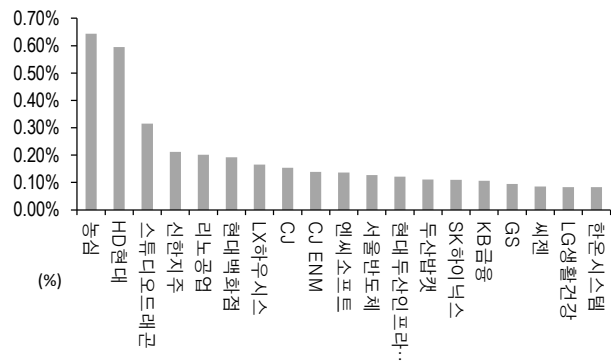
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배출 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,368,935	2,672.8	4,205,928	98,941	-65,739	28,036	34,012	-12.6	10.8	-0.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	174,300	-0.40	73.0	107.3	29,209	-1,833	-0.08%	-882	-1,053	1,945	1,974	71
메리츠증권	6,600	1.54	4.2	95.3	75,532	1,271	-0.08%	1,157	-2,871	1,714	134	0
영진약품	2,870	-1.20	1.3	92.1	15,031	4,470	-1.05%	-3,173	493	2,680	2,680	0
넷마블	57,200	1.42	8.3	79.6	5,890	-1,160	-0.16%	-1,311	727	584	435	149
삼성전자	59,500	-0.17	490.8	77.7	1,093,085	-3,606	0.03%	-3,812	9,088	-10,148	-12,343	1,885
일진머티리얼즈	64,200	0.31	14.1	73.9	44,790	-456	0.05%	-1,456	199	1,257	1,317	-45
삼성전기	150,700	0.33	27.1	73.4	11,718	-142	0.01%	1,981	-624	-1,337	-1,253	-84
한샘	49,100	1.45	1.6	67.7	12,602	1,606	-5.72%	1,573	-59	-1,514	-1,687	29
LG 화학	730,000	1.11	107.8	66.8	8,673	461	-0.06%	101	206	-307	-327	23
NAVER	198,000	0.56	86.7	65.5	22,081	1,556	-0.04%	2,406	207	-2,588	-2,340	-218

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터