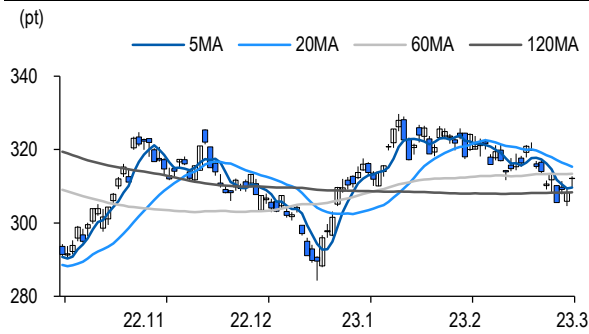


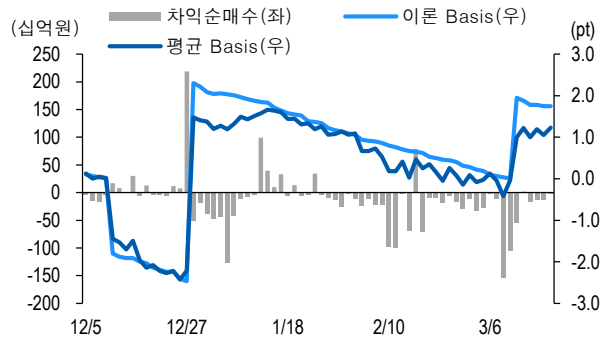
선물옵션시장 지표

2023.3.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.07	1.19	3.68	6,532.6	-
선물 6월물	313.40	1.23	3.80	18,274.0	306,512
선물 9월물	314.90	1.32	4.10	19.1	19,949
4월물(mini)	312.08	1.21	3.72	1,387.6	68,565
5월물(mini)	312.80	1.31	4.04	3.9	7,253

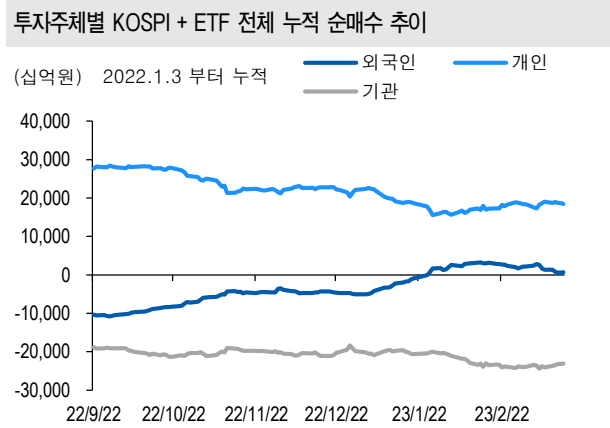


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.75	1.23	1.33	-0.17%
베이스스(mini)	0.02	-0.05	0.01	-0.02%
제1스프레드(SP)	1.94	1.48	1.50	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	0.00	0.00	-0.01%

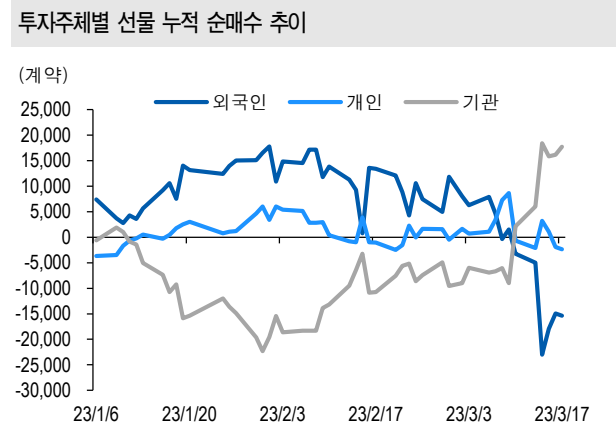


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	73.5	6.5	80.0	4.6	60.0	96.4	-132.7	8.8	-2.4	-6.2
개인	-174.2	-52.4	-226.6	0.0	11.6	-34.4	2.6	-9.9	0.1	23.6
기관	81.5	38.8	120.3	-6.4	-51.4	-5.0	129.8	1.2	2.4	-20.2
금융투자	38.9	7.5	46.4	-3.7	1.3	-574.1	125.2	1.3	2.6	-33.9
투신	23.9	0.9	24.9	-0.2	-6.4	550.8	4.5	-0.2	0.0	12.8
은행+보험+기타금융	9.8	42.2	52.0	0.0	-14.3	15.1	0.1	-0.1	0.0	0.5
연기금+국가자재	-20.3	-9.5	-29.9	0.0	-27.0	3.2	0.0	0.3	-0.2	0.4
기타법인	19.3	3.0	22.3	0.0	1.4	-57.0	0.4	-0.1	-0.1	2.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



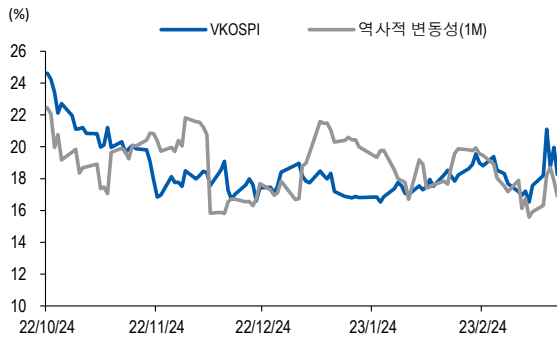
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	536,623	218.9	799,752	16.5%	지수옵션 전체	1,066,856	402.0	1,985,213		
Put	530,233	183.2	1,185,461	18.3%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	18.26%(-1.71%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	4.36	0.96	19,825	13,244	-432	16.4	Put	310.0(K+1)	4.88	-2.27	9,446	14,991	992	17.2
	312.5(K+2)	5.58	1.17	15,401	6,674	1,061	16.8		307.5(K+0)	3.95	-2.02	11,216	10,020	394	17.5
	310.0(K+1)	6.97	1.35	15,113	10,200	-3,927	17.1		305.0(K-1)	3.17	-1.78	16,500	14,009	826	17.9
	307.5(K+0)	8.52	1.66	1,020	4,035	-147	17.4		302.5(K-2)	2.53	-1.55	28,840	17,534	599	18.2
	305.0(K-1)	10.20	1.90	320	1,899	38	17.6		300.0(K-3)	2.02	-1.34	48,703	26,518	1,718	18.7

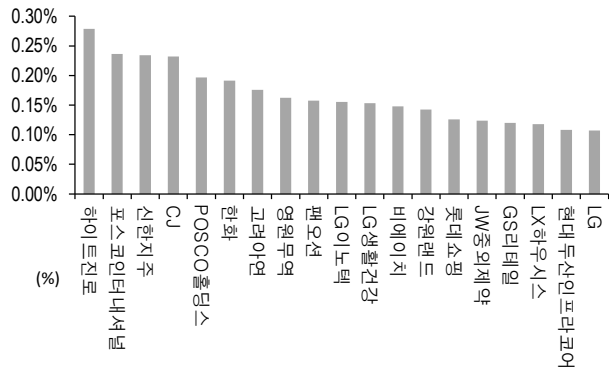
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,246,226	2,452.2	4,266,799	60,871	66,488	-10,999	-58,415	-6.2	23.6	-20.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	3,005	4.70	0.9	77.6	12,340	-2,691	-0.23%	5,462	1,058	-6,520	-6,520	0
NAVER	198,600	0.30	103.6	67.8	23,448	1,367	-0.03%	-308	788	-535	-1,427	207
CJ CGV	15,020	1.01	1.3	60.0	17,748	-1,323	-0.61%	1,692	-2,624	1,002	1,002	0
현대차	176,500	1.26	51.8	58.2	29,537	328	-0.06%	-854	778	73	-37	-140
메리츠증권	6,720	1.82	4.6	57.8	77,079	1,547	-0.09%	-5,693	1,291	4,407	2,907	0
넥센타이어	7,370	0.41	0.7	57.3	11,557	393	-0.03%	2,017	-332	-1,685	-1,685	0
SK 하이닉스	84,100	6.32	288.4	56.1	180,116	-13,650	0.08%	4,669	-14,192	7,511	-6,212	29
삼성전자	60,900	2.35	452.9	53.6	1,089,353	-3,732	-0.04%	-2,026	-14,443	16,551	11,730	1,100
삼성전기	152,900	1.46	35.0	50.1	10,773	-945	-0.06%	1,132	-44	-1,086	-1,447	561
LG 전자	118,400	0.77	51.9	48.4	38,910	-1,195	-0.14%	-2,445	-512	2,744	4,172	-1,124

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터