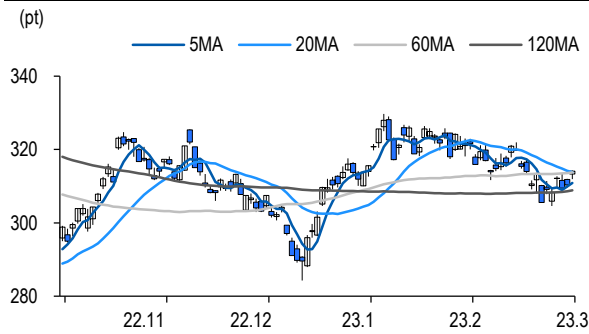


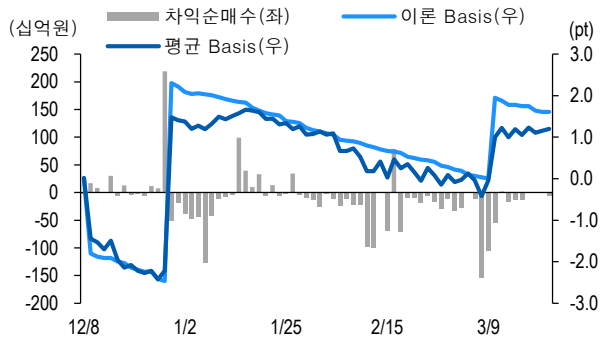
선물옵션시장 지표

2023.3.23

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.11	1.21	3.75	5,021.8	-
선물 6월물	315.40	1.14	3.55	14,985.7	303,426
선물 9월물	316.75	1.18	3.70	11.8	19,624
4월물(mini)	314.00	1.13	3.50	1,039.5	76,333
5월물(mini)	314.56	1.18	3.66	5.1	7,614

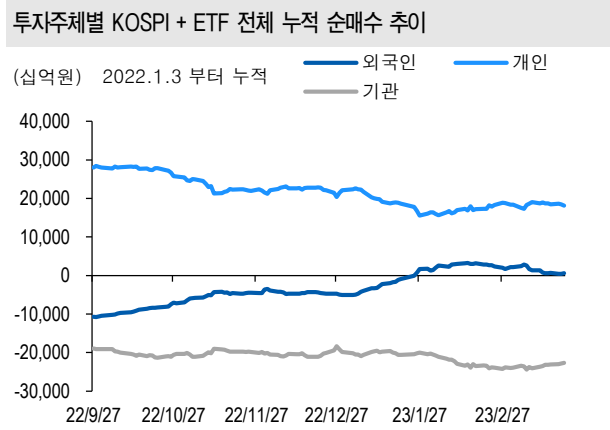


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.61	1.20	1.29	-0.13%
베이스스(mini)	-0.13	-0.14	-0.11	0.00%
제1스프레드(SP)	1.97	1.35	1.35	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.13	-0.11	-0.11	0.01%

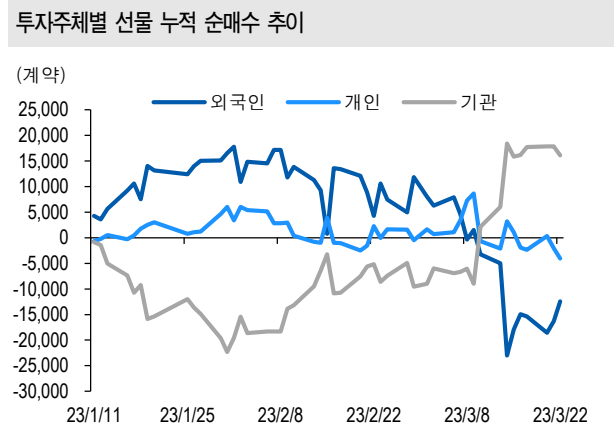


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	203.1	-5.3	197.8	0.1	99.7	308.7	-2.7	-0.4	-0.6	-6.0
개인	-347.5	-3.7	-351.2	0.0	-1.9	-155.4	-3.5	0.2	0.7	31.2
기관	143.2	22.2	165.4	-6.1	-47.9	-141.9	5.0	0.2	-0.1	-28.7
금융투자	100.1	-14.7	85.4	-2.7	2.4	-405.1	3.6	1.2	-1.0	-37.8
투신	15.8	-3.7	12.2	0.0	-9.0	233.2	1.4	0.0	-0.1	11.2
은행+보험+기타금융	16.5	6.3	22.7	0.0	-1.4	28.9	0.0	-1.0	1.0	0.0
연기금+국가자자체	-10.4	21.9	11.5	0.0	-40.5	1.1	0.0	0.0	0.0	-2.1
기타법인	1.1	-9.1	-8.0	0.0	1.0	-11.3	1.2	0.0	0.0	3.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



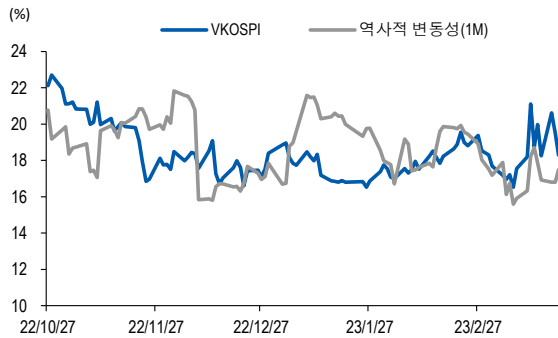
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	405,272	155.0	855,394	16.2%	지수옵션 전체	833,597	289.4	2,138,393
Put	428,325	134.4	1,282,999	18.3%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	18.29%(-1.22%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	3.58	0.92	26,027	15,361	1,436	16.3	Put	312.5(K+1)	4.59	-2.17	7,022	6,313	1,524	17.0
	315.0(K+2)	4.73	1.13	13,404	13,873	563	16.6		310.0(K+0)	3.65	-1.86	9,586	16,474	503	17.4
	312.5(K+1)	6.10	1.38	10,871	7,594	748	17.0		307.5(K-1)	2.88	-1.59	16,739	11,652	918	17.8
	310.0(K+0)	7.65	1.64	2,277	9,328	-311	17.4		305.0(K-2)	2.25	-1.35	31,299	17,915	1,293	18.3
	307.5(K-1)	9.32	1.89	472	3,996	50	17.6		302.5(K-3)	1.74	-1.13	25,103	17,736	146	18.7

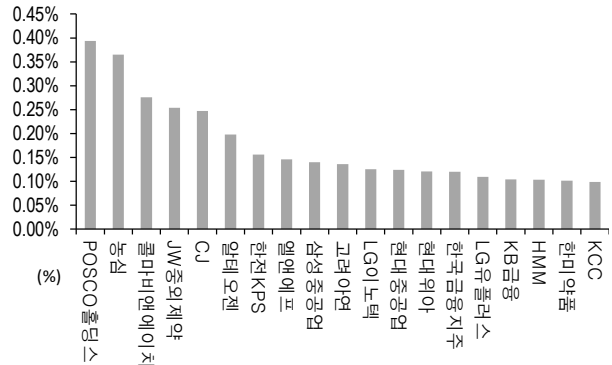
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,260,048	1,867.6	4,320,583	-19,116	-56,730	26,698	26,833	-6.0	31.2	-28.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한샘	52,300	6.95	3.2	75.2	19,011	1,751	-0.97%	-1,572	257	1,315	3,376	0
SK 하이닉스	86,600	3.46	133.6	59.8	166,670	-8,754	0.05%	-5,960	4,085	2,040	1,150	607
삼성전자	60,900	1.50	321.1	58.8	1,096,104	-19,102	0.05%	5,644	-15,368	9,583	4,527	403
CJ	100,200	-0.50	6.9	57.5	34,416	4,184	0.25%	-1,884	4,766	-2,882	-2,880	-2
LG 전자	114,300	0.70	48.2	55.7	31,702	-450	-0.01%	990	-1,809	819	-157	976
영진약품	2,985	0.67	0.5	55.3	6,621	-330	-0.20%	-1,741	28	1,713	1,713	0
현대건설	36,700	0.41	6.9	52.8	16,638	3,565	-0.07%	-1,696	4	1,692	1,013	679
에스엠	84,700	-1.05	47.0	51.4	152,411	13,845	-25.45%	4,388	2,947	-7,649	-14,728	0
삼성전기	150,800	0.20	20.6	49.5	10,903	-233	-0.05%	602	-214	-388	-436	168
LG 화학	703,000	3.53	70.4	49.1	7,807	132	-0.05%	421	-87	-334	-702	261

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터