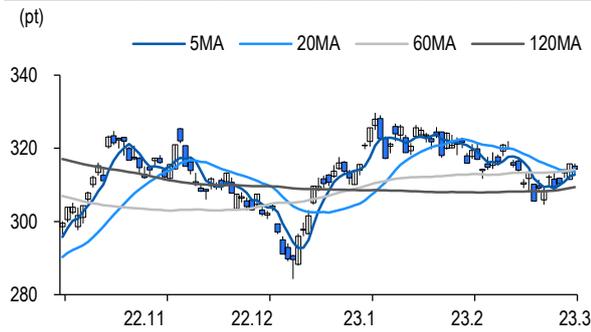


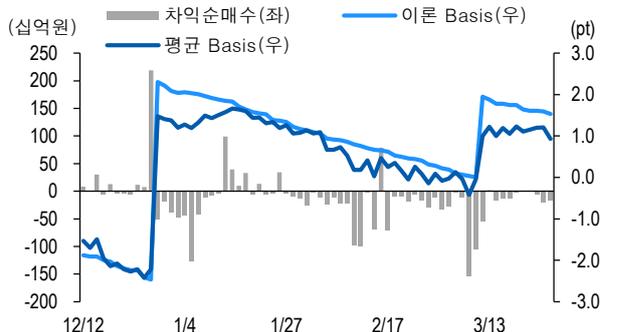
선물옵션시장 지표

2023.3.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.30	-0.46	-1.45	5,684.3	-
선물 6월물	315.30	-0.25	-0.80	17,015.8	308,743
선물 9월물	316.45	-0.39	-1.25	15.6	19,703
4월물(mini)	313.92	-0.27	-0.86	1,210.4	73,487
5월물(mini)	314.60	-0.21	-0.66	4.3	7,610

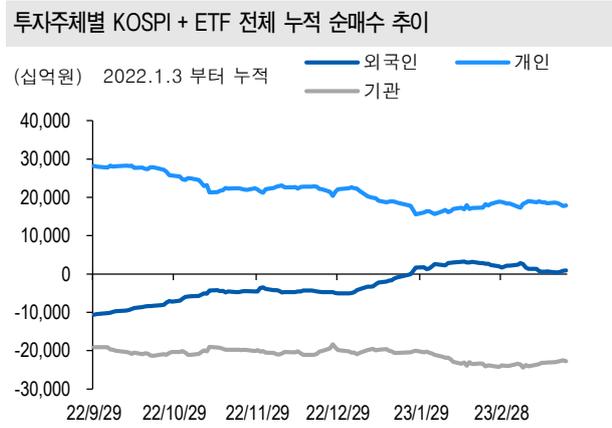


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.53	0.93	1.00	-0.19%
베이스(mini)	-0.20	-0.36	-0.38	-0.05%
제1스프레드(SP)	1.97	1.43	1.35	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	-0.20	-0.38	-0.38	-0.06%

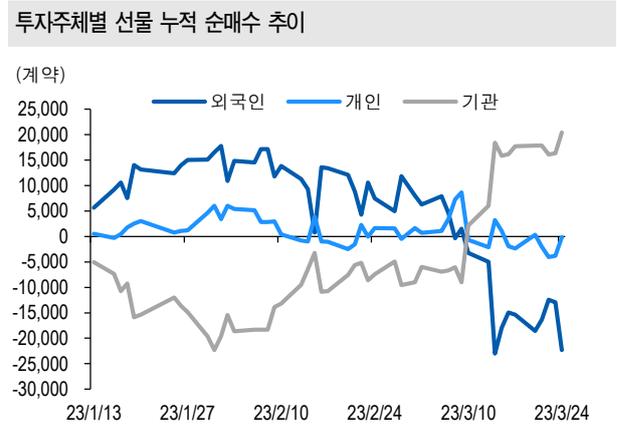


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	46.1	25.2	71.2	0.1	50.4	-784.9	51.1	11.4	-0.3	0.6
개인	181.7	-36.9	144.8	0.0	1.6	285.9	-1.9	-11.3	-1.4	-27.3
기관	-232.9	8.4	-224.5	-16.4	-10.2	368.5	-49.7	-0.3	1.7	25.6
금융투자	-306.3	0.6	-305.7	-16.0	-7.1	344.4	-49.6	-0.1	1.7	24.1
투신	31.3	19.9	51.2	0.0	-2.2	-3.5	-0.1	-0.2	-0.1	6.4
은행+보험+기타금융	4.5	-6.0	-1.5	0.0	-1.2	13.5	0.0	0.0	0.0	0.1
연기금+국가자자체	-5.7	-10.1	-15.8	1.6	-5.6	14.1	0.0	0.0	0.0	-5.0
기타법인	5.2	5.6	10.8	0.0	1.2	130.5	0.5	0.2	0.0	1.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

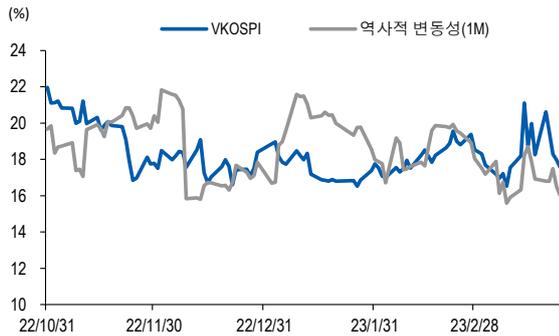
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	536,224	168.4	894,456	14.5%	지수옵션 전체	1,034,297	326.8	2,249,800			
Put	498,073	158.4	1,355,344	16.9%	PCR(금액기준)	0.94	VKOSPI	17.59%(-0.38%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.43	-0.44	68,804	18,245	1,072	14.5	Put	317.5(K+1)	6.63	0.28	2,026	2,911	-128	15.8
	320.0(K+2)	2.14	-0.53	73,506	27,890	94	14.8		315.0(K+0)	5.27	0.18	6,873	10,683	139	16.1
	317.5(K+1)	3.06	-0.63	26,682	16,906	1,741	15.1		312.5(K-1)	4.12	0.07	12,046	8,993	811	16.4
	315.0(K+0)	4.19	-0.73	12,851	14,738	-435	15.3		310.0(K-2)	3.19	0.00	25,938	17,848	783	16.7
	312.5(K-1)	5.53	-0.99	13,640	9,835	-6,018	15.6		307.5(K-3)	2.41	-0.05	33,245	13,322	-118	17.0

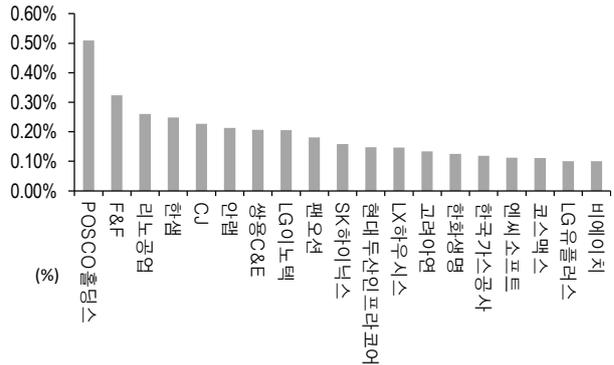
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,304,814	2,516.8	4,388,533	94,491	7,972	-27,325	20,369	0.6	-27.3	25.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메리츠증권	6,390	-2.44	7.0	182.0	65,315	-5,309	0.06%	7,251	-2,033	-5,218	-7,064	0
에스엠	88,100	2.09	47.3	137.0	158,352	11,290	-18.97%	-3,665	1,502	2,072	-1,341	15
현대차	177,700	-1.66	88.3	76.8	29,291	-3,001	-0.04%	-3,395	-341	3,730	3,256	674
SK 하이닉스	87,300	-1.13	258.4	72.6	189,489	9,122	0.16%	26,204	-9,373	-18,492	-21,460	19
넥센타이어	7,470	-0.93	0.5	67.4	10,589	-1,085	-0.15%	-1,254	56	1,198	1,198	0
현대건설	35,950	0.28	6.9	56.2	16,558	-483	-0.03%	1,721	-35	-1,686	-1,486	-200
LG 전자	113,000	0.89	53.4	53.6	28,531	-2,689	0.00%	3,445	-4,806	1,411	-373	1,784
삼성전자	62,500	1.13	575.0	52.4	1,120,556	37,074	-0.03%	-18,778	-19,062	37,694	36,354	-3,075
한샘	51,100	-2.48	1.4	51.0	17,167	-592	0.25%	-250	-39	289	0	0
한올바이오파마	17,980	1.47	4.4	50.6	10,638	4,444	-0.53%	-4,784	1,450	3,334	3,334	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터