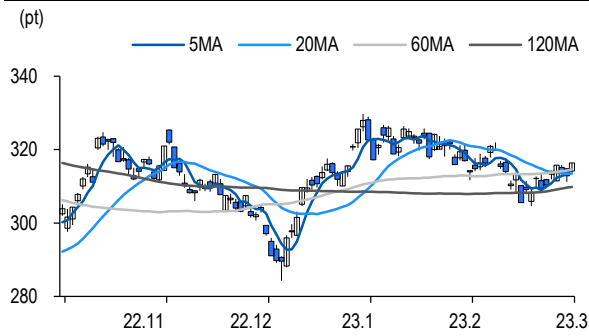


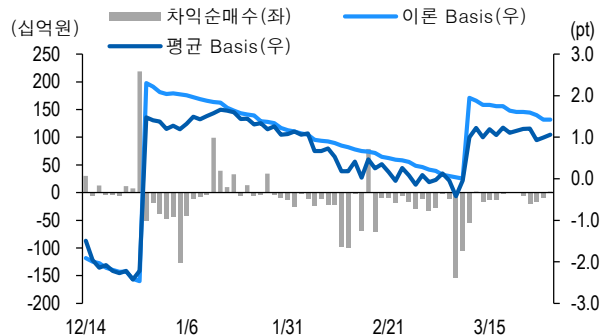
선물옵션시장 지표

2023.3.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.36	1.12	3.51	5,272.5	-
선물 6월물	317.45	1.02	3.20	16,810.8	308,130
선물 9월물	318.80	1.05	3.30	15.2	19,686
4월물(mini)	316.04	1.02	3.18	1,399.9	78,040
5월물(mini)	316.90	1.05	3.30	3.1	9,263

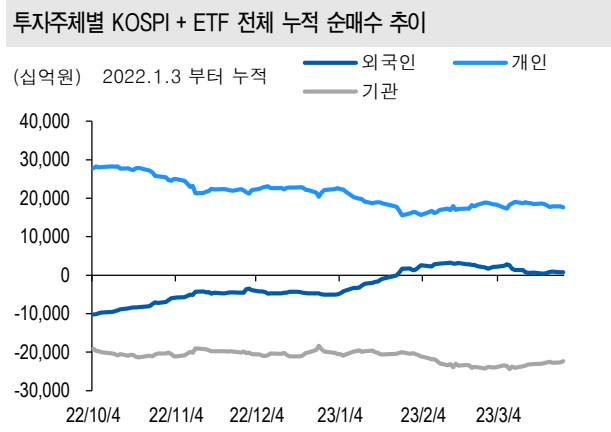


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.42	1.06	1.09	-0.11%
베이스스(mini)	-0.32	-0.30	-0.32	0.01%
제1스프레드(SP)	1.97	1.34	1.45	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.32	-0.28	-0.28	0.01%

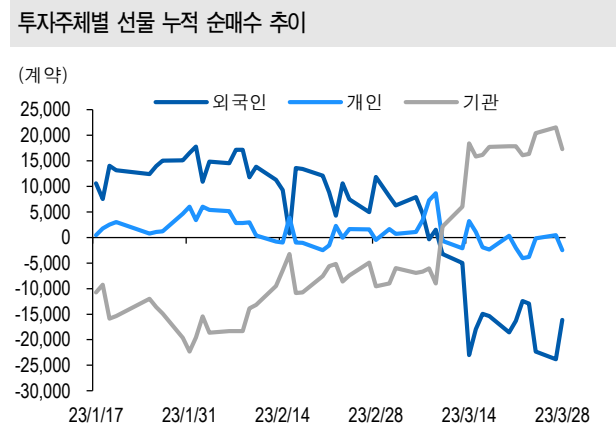


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-43.0	-23.9	-66.9	0.0	88.4	669.2	-61.3	-11.4	-2.4	-1.4
개인	-279.2	34.4	-244.7	0.0	0.6	-210.9	-19.6	11.0	1.4	45.7
기관	323.0	-9.1	314.0	2.1	-40.2	-418.8	81.5	0.3	1.6	-45.7
금융투자	308.7	-75.1	233.5	0.1	-5.7	-666.0	78.9	0.2	0.7	-54.5
투신	7.9	-12.2	-4.4	0.0	-22.3	231.1	2.6	0.1	0.0	13.7
은행+보험+기타금융	-6.0	95.5	89.5	0.0	-3.5	15.6	0.1	0.0	0.9	-0.2
연기금+국가자재	-18.7	-7.4	-26.0	0.0	-6.9	0.5	0.0	0.0	0.0	-4.7
기타법인	-0.9	-7.3	-8.1	0.0	0.4	-39.5	-0.6	0.1	-0.5	1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

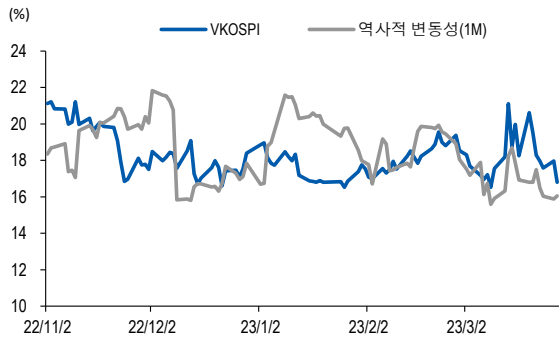
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	522,555	154.7	930,380	14.7%	지수옵션 전체	1,151,457	285.8	2,348,171			
Put	628,902	131.2	1,417,791	16.6%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	16.81%(-1.16%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	2.37	0.75	63,107	27,641	23	14.7	Put	315.0(K+1)	3.70	-1.87	8,879	12,373	1,292	15.5
	317.5(K+2)	3.46	1.03	39,225	19,977	-521	15.2		312.5(K+0)	2.73	-1.59	16,385	9,507	1,070	15.8
	315.0(K+1)	4.75	1.31	18,276	16,580	1,362	15.5		310.0(K-1)	1.98	-1.31	42,249	19,027	1,327	16.2
	312.5(K+0)	6.31	1.63	12,514	15,901	6,919	15.9		307.5(K-2)	1.39	-1.07	34,977	15,382	2,365	16.5
	310.0(K-1)	8.01	1.87	1,385	9,682	-11	16.0		305.0(K-3)	0.98	-0.86	57,257	21,262	2,764	16.9

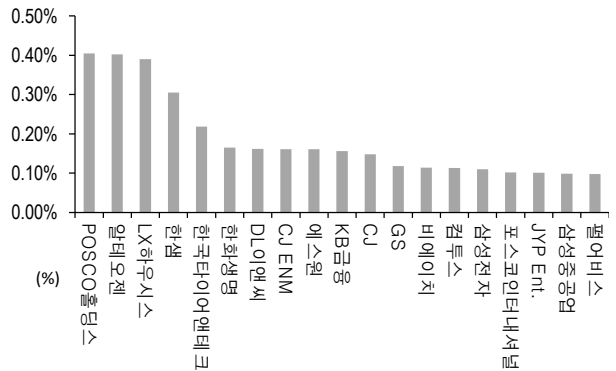
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,721,335	2,497.7	4,440,605	18,478	30,986	48,606	-82,945	-1.4	45.7	-45.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	176,800	0.45	52.1	86.7	28,718	-1,084	-0.01%	-1,038	792	245	378	-133
삼성전자	62,500	0.64	561.9	77.9	1,108,020	-25,424	0.11%	-10,242	35,492	-26,597	-29,364	1,600
영진약품	2,955	3.32	0.9	76.2	7,306	-2,456	-0.21%	6,110	-469	-5,641	-5,641	0
삼성전기	155,400	0.32	30.1	68.9	9,956	-552	-0.08%	-1,089	1,264	-175	243	-418
BGF	4,215	2.06	0.4	68.3	8,942	109	-0.21%	878	220	-1,098	-1,098	0
SK 하이닉스	88,200	2.80	158.8	61.1	197,891	-3,080	0.07%	-4,371	-3,583	6,772	3,428	2,951
삼성 SDI	724,000	-0.14	71.9	58.5	12,573	370	0.05%	903	-96	-806	-148	-643
호텔신라	78,900	-0.50	8.3	57.2	9,877	-322	0.00%	601	-840	239	367	-128
한국전력	18,470	0.22	11.6	54.1	87,990	3,971	0.02%	-10,121	8,104	2,137	-2,495	4,632
포스코케미칼	266,500	0.00	118.9	53.0	19,767	-1,263	-0.06%	-1,753	-699	2,519	2,233	464

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터