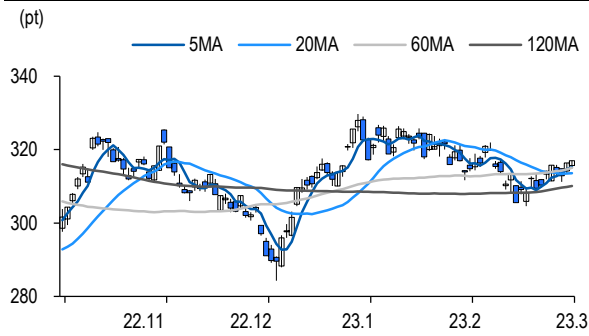


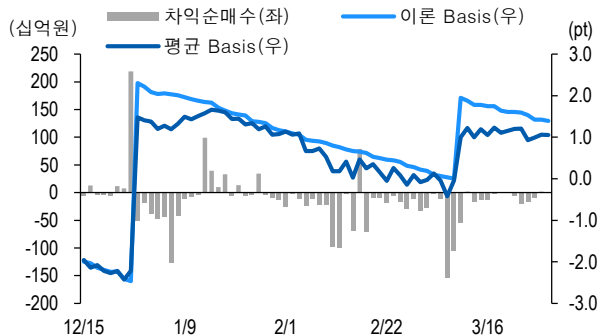
선물옵션시장 지표

2023.3.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.01	0.21	0.65	5,794.0	-
선물 6월물	317.90	0.14	0.45	14,432.3	305,361
선물 9월물	319.25	0.14	0.45	14.0	19,697
4월물(mini)	316.58	0.17	0.54	1,165.5	74,731
5월물(mini)	317.44	0.17	0.54	2.6	9,287

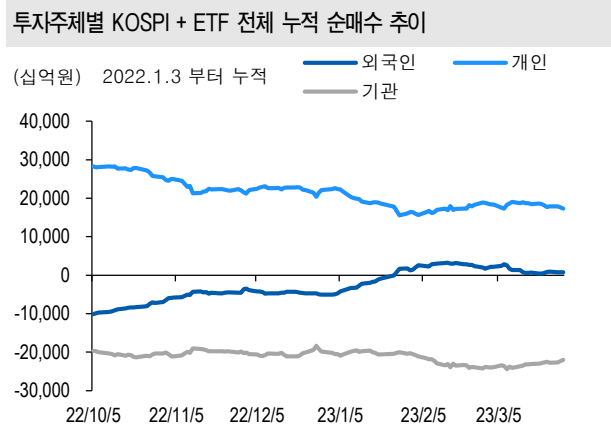


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.39	1.05	0.89	-0.11%
베이스(mini)	-0.35	-0.28	-0.43	0.02%
제1스프레드(SP)	1.97	1.45	1.45	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	-0.35	-0.36	-0.36	0.00%

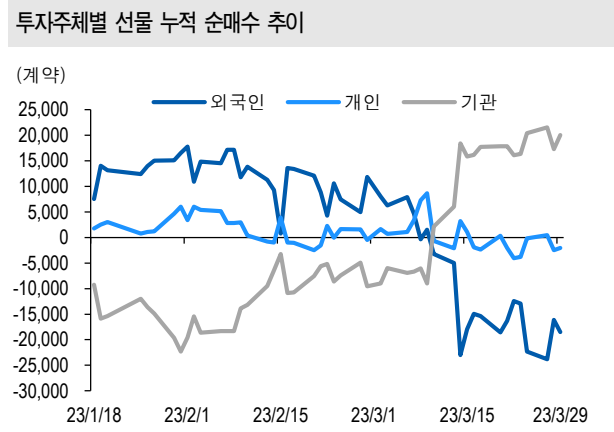


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	2.3	25.5	27.8	0.0	164.5	-297.8	108.3	-3.2	-0.1	16.3
개인	-328.4	-15.8	-344.3	0.0	-4.6	41.4	-4.3	2.9	-2.1	-6.3
기관	327.0	-10.3	316.7	-0.9	-27.4	322.6	-104.1	-0.2	1.6	-9.0
금융투자	203.2	32.5	235.7	0.0	1.0	266.9	-103.5	-0.2	1.7	-12.7
투신	17.5	-15.0	2.6	0.0	-5.3	31.2	-0.7	0.0	0.0	0.9
은행+보험+기타금융	0.7	1.5	2.2	0.0	-1.8	13.2	0.1	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	40.9	-14.4	26.5	0.0	-10.7	11.3	0.0	0.0	0.0	2.8
기타법인	-0.8	-4.1	-4.9	0.0	-0.7	-66.2	0.0	0.4	0.5	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



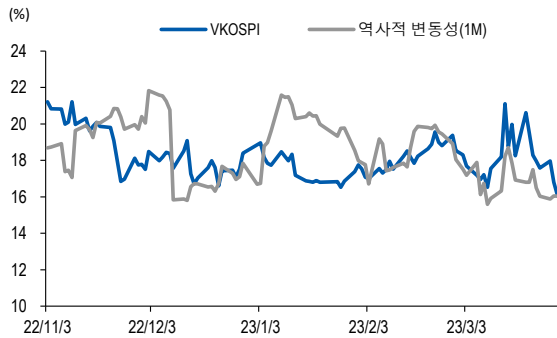
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	457,746	125.7	939,117	14.0%	지수옵션 전체	988,410	251.7	2,388,147			
Put	530,664	126.0	1,449,030	15.4%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	16.15%(-0.66%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.96	0.00	103,175	35,547	1,685	13.9	Put	320.0(K+1)	5.73	-0.56	1,990	6,306	143	14.5
	322.5(K+2)	1.57	0.06	67,444	21,113	110	14.2		317.5(K+0)	4.34	-0.52	4,468	3,501	236	14.8
	320.0(K+1)	2.42	0.05	62,711	28,309	668	14.5		315.0(K-1)	3.14	-0.56	15,991	13,268	895	14.9
	317.5(K+0)	3.49	0.03	24,739	19,833	-144	14.7		312.5(K-2)	2.23	-0.50	30,444	10,544	1,037	15.2
	315.0(K-1)	4.79	0.04	7,802	16,394	-186	14.7		310.0(K-3)	1.54	-0.44	47,955	19,738	711	15.4

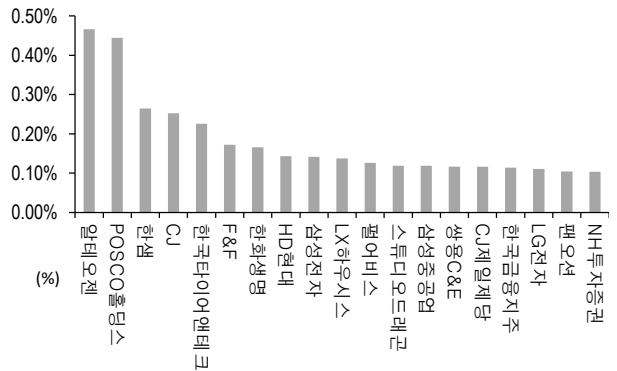
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,297,976	2,001.0	4,443,980	3,375	-16,355	-8,247	25,315	16.3	-6.3	-9.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	2,880	-2.54	1.2	121.9	5,836	-1,470	-0.17%	-2,712	192	2,520	2,520	0
JW 중외제약	20,400	-1.45	1.3	81.8	2,248	245	-0.02%	483	89	-572	-572	0
넥센타이어	7,880	-0.25	1.0	77.5	5,381	-2,053	-0.08%	2,298	-102	-2,196	-2,196	0
현대차	180,600	2.15	65.8	64.5	31,199	2,481	0.00%	3,061	-493	-2,571	-2,851	282
NAVER	199,400	-0.10	54.4	62.3	24,833	-1,268	-0.03%	-611	-207	816	411	429
한올바이오파마	18,290	-0.92	1.6	56.2	10,530	-536	-0.38%	985	-978	-7	-7	0
에스엠	97,500	3.28	44.7	55.0	89,292	-11,758	-0.30%	2,031	-4,015	2,462	4,343	0
삼성전자	62,500	0.00	367.2	53.1	1,089,542	-18,478	0.14%	9,121	3,463	-12,728	-15,752	1,600
넷마블	65,300	0.31	7.6	53.1	7,072	-198	-0.16%	-1,181	-43	1,224	1,185	39
SK 하이닉스	86,900	-1.47	139.9	52.7	187,036	-10,855	0.08%	-4,202	-2,052	7,151	9,185	-861

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터