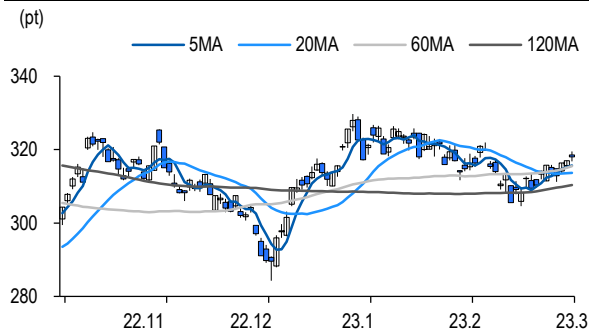


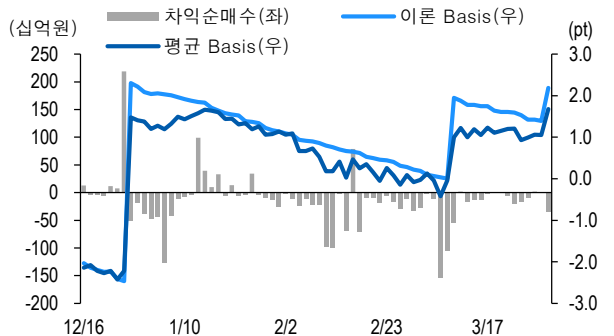
선물옵션시장 지표

2023.3.31

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	318.05	0.33	1.04	7,278.7	-
선물 6월물	319.90	0.63	2.00	21,364.0	310,485
선물 9월물	321.45	0.69	2.20	22.9	20,215
4월물(mini)	318.52	0.61	1.94	2,022.0	81,513
5월물(mini)	319.22	0.56	1.78	4.7	9,386

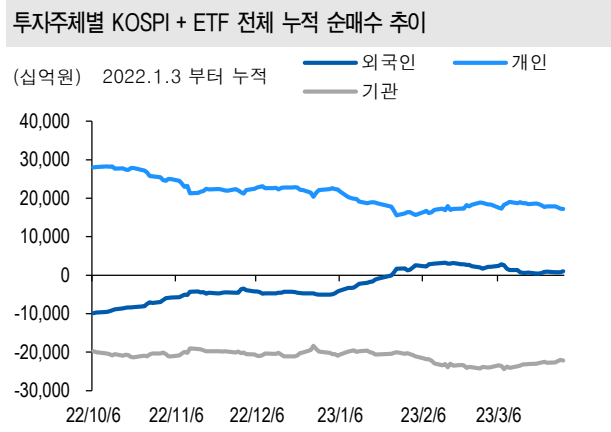


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	2.19	1.68	1.85	-0.16%
베이스스(mini)	0.44	0.29	0.47	-0.05%
제1스프레드(SP)	1.99	1.46	1.45	-0.17%
합성선물 베이스스(ATM)	0.44	0.42	0.42	-0.01%

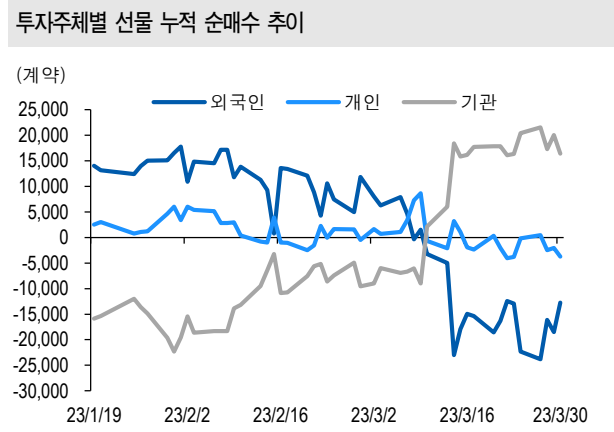


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	262.9	14.5	277.4	0.1	238.4	776.0	-310.1	17.3	-0.9	-33.0
개인	-119.4	25.3	-94.1	0.0	-1.7	-139.2	-0.5	-14.9	-1.6	10.6
기관	-144.1	-38.0	-182.1	-34.7	-50.0	-603.5	310.9	-2.4	2.8	20.5
금융투자	-62.6	37.8	-24.8	-30.7	-5.3	-488.0	309.4	-3.2	2.9	27.3
투신	-17.4	9.4	-8.0	0.0	-14.3	-70.4	1.6	0.2	-0.1	-4.3
은행+보험+기타금융	-3.8	-92.8	-96.7	0.0	-3.5	7.3	-0.1	0.6	0.1	0.0
연기금+국가자자체	4.9	-1.3	3.6	0.1	-3.0	-52.5	0.0	0.0	0.0	-2.4
기타법인	0.6	-0.5	0.1	0.0	0.1	-33.3	-0.2	0.0	-0.3	1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

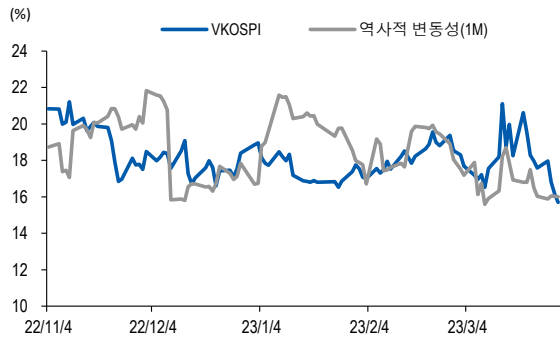
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	721,662	218.1	955,799	13.5%	지수옵션 전체	1,503,115	392.8	2,445,590			
Put	781,453	174.7	1,489,791	14.8%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	15.70%(-0.45%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	1.19	0.23	134,121	33,382	-2,165	13.5	Put	320.0(K+1)	4.34	-1.39	9,472	9,111	2,805	13.8
	322.5(K+2)	1.89	0.32	81,202	20,910	-203	13.6		317.5(K+0)	3.15	-1.19	27,298	8,765	5,264	14.2
	320.0(K+1)	2.86	0.44	57,213	30,731	2,422	13.8		315.0(K-1)	2.15	-0.99	50,674	16,107	2,839	14.2
	317.5(K+0)	4.12	0.63	19,347	20,826	993	14.0		312.5(K-2)	1.49	-0.74	65,853	12,585	2,041	14.7
	315.0(K-1)	5.68	0.89	5,317	15,257	-1,137	14.3		310.0(K-3)	0.97	-0.57	131,162	25,671	5,933	15.0

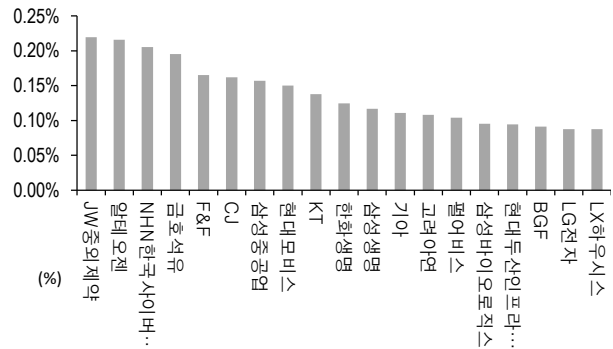
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

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	3,655,133	2,795.8	4,546,747	102,767	-1,829	15,813	-17,142	-33.0	10.6	20.5				

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	2,905	0.87	1.1	85.9	7,194	1,358	0.03%	6,256	454	-6,710	-6,710	0
현대차	181,700	0.61	76.5	80.4	30,101	-1,098	-0.01%	-1,615	-728	2,371	2,367	4
삼성전기	153,400	-0.90	34.3	63.6	10,872	919	-0.02%	-1,695	1,040	658	381	277
삼성에스디에스	117,300	-2.90	16.0	62.8	9,496	6,085	-0.28%	420	-5,019	4,988	4,986	2
SK 하이닉스	88,700	2.07	227.7	60.0	191,438	4,402	-0.01%	1,886	973	-2,955	-2,842	-952
NAVER	202,000	1.30	86.6	57.3	30,120	5,287	0.02%	-1,873	4,011	-2,988	-2,711	-277
삼성전자	63,300	1.28	527.8	55.3	1,109,376	19,834	-0.02%	-11,808	-1,126	13,003	17,483	-4,000
JW 중외제약	20,700	1.47	0.6	55.0	2,122	-126	0.22%	-312	279	33	33	0
포스코케미칼	261,000	-2.25	122.8	51.2	19,860	-103	-0.04%	-2,368	-92	2,442	2,661	-212
넷마블	64,600	-1.07	5.5	50.3	7,136	64	-0.06%	98	198	-296	-286	-10

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터