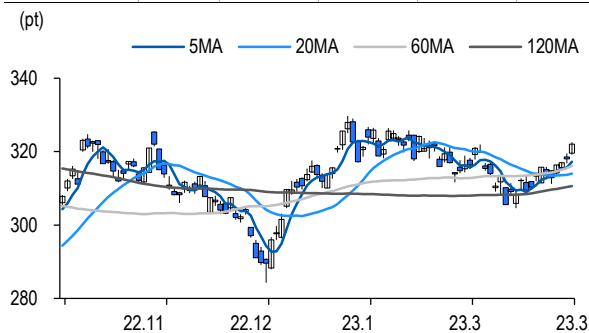


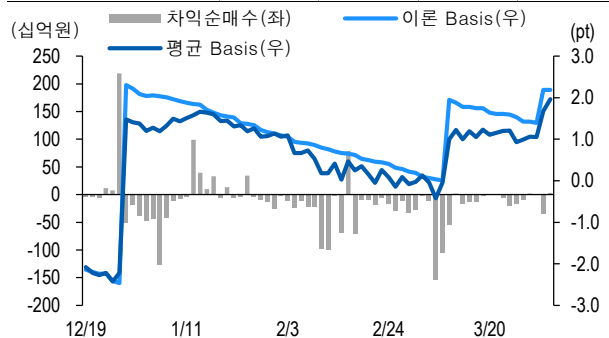
선물옵션시장 지표

2023.4.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.03	1.25	3.98	9,430.8	-
선물 6월물	323.70	1.19	3.80	18,547.7	321,041
선물 9월물	325.05	1.12	3.60	14.8	20,234
4월물(mini)	322.20	1.16	3.68	1,306.9	89,361
5월물(mini)	323.14	1.23	3.92	5.6	9,423



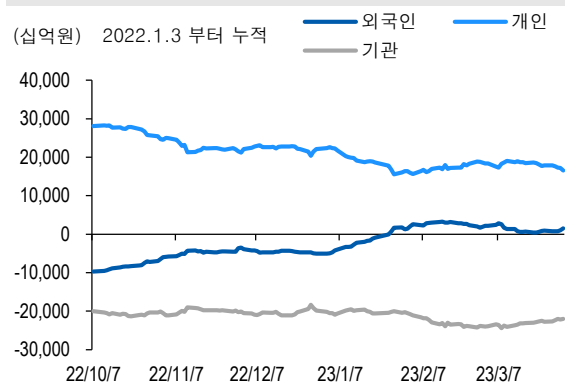
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.19	1.96	1.67	-0.07%
베이스(mini)	0.41	0.45	0.17	0.01%
제1스프레드(SP)	2.02	1.45	1.50	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	0.41	0.12	0.12	-0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	514.1	-17.7	496.4	0.1	594.2	732.5	-66.4	-2.5	-0.7	-24.2
개인	-721.0	24.2	-696.8	0.0	1.2	-156.6	-1.7	3.1	0.3	13.4
기관	206.4	12.6	219.0	2.8	-20.5	-572.8	68.4	-1.4	0.8	9.8
금융투자	215.3	11.0	226.3	-6.1	-1.1	-769.2	65.9	-2.2	1.0	7.3
투신	3.6	17.2	20.8	0.0	-3.8	166.0	2.6	0.1	-0.1	2.4
은행+보험+기타금융	1.5	-15.7	-14.2	0.0	-3.8	41.5	-0.1	0.7	-0.1	0.2
연기금+국가지자체	8.1	-2.9	5.2	9.0	-12.4	-11.1	0.0	0.0	0.0	-0.1
기타법인	0.5	-15.7	-15.2	0.0	0.7	-3.1	-0.3	0.8	-0.4	1.1

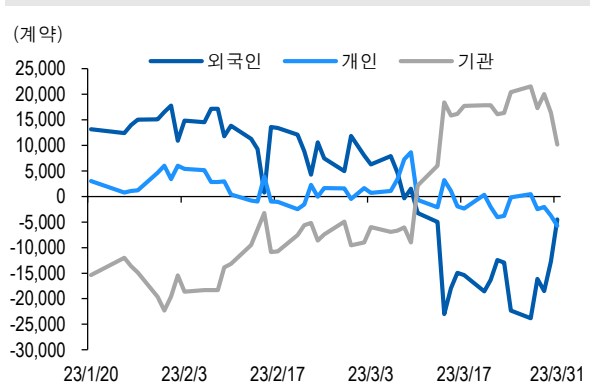
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



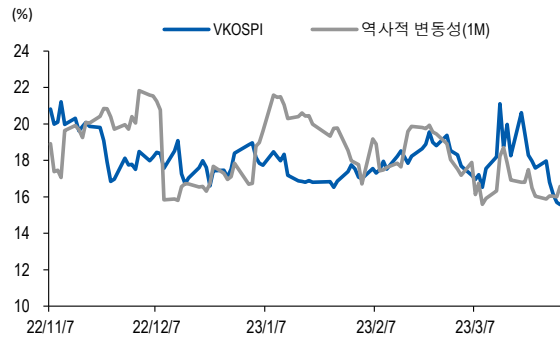
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	703,574	203.1	947,457	12.9%	지수옵션 전체	1,413,237	354.2	2,502,710
Put	709,663	151.1	1,555,253	15.3%	PCR(금액기준)	0.74	VKOSPI	15.57%(-0.13%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	2.16	0.97	85,896	31,167	-2,215	12.9	Put	320.0(K+1)	2.57	-1.77	38,211	14,100	4,989	14.7
	322.5(K+2)	3.28	1.39	40,401	19,293	-1,617	13.1		317.5(K+0)	1.74	-1.41	70,469	10,947	2,182	14.8
	320.0(K+1)	4.70	1.84	19,732	30,431	-300	13.2		315.0(K-1)	1.14	-1.01	78,850	19,211	3,104	15.1
	317.5(K+0)	6.39	2.27	5,489	20,807	-19	13.4		312.5(K-2)	0.73	-0.76	89,418	16,694	4,109	15.4
	315.0(K-1)	8.28	2.60	2,111	14,966	-291	13.2		310.0(K-3)	0.46	-0.51	94,226	35,518	9,847	15.7

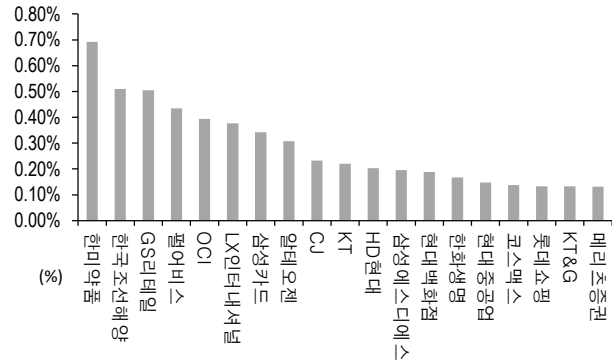
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,270,368	2,517.8	4,584,240	37,493	-60,003	-9,647	68,084	-24.2	13.4	9.8			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	2,930	0.86	0.9	78.5	7,529	335	-0.27%	-3,937	-216	4,153	4,153	0
현대차	184,200	1.38	68.3	56.5	32,200	2,099	0.01%	78	1,132	-1,296	-884	-412
SK 하이닉스	88,600	-0.11	133.2	56.4	182,621	-8,817	-0.03%	-15,239	2,028	13,223	13,527	-381
한올바이오파마	18,330	-1.19	2.0	56.1	8,664	-1,778	-0.10%	3,194	152	-3,346	-3,346	0
GKL	20,000	0.15	2.6	49.3	13,214	817	-0.14%	1,569	-449	-1,120	-1,120	0
현대제철	34,650	1.61	11.4	48.5	27,747	4,050	-0.06%	-2,499	323	2,073	1,694	379
삼성전기	152,900	-0.33	19.8	46.6	10,403	-469	0.00%	-345	13	339	104	149
에스엠	93,600	-0.53	17.8	43.0	78,763	-5,392	-0.17%	580	-1,601	1,021	1,161	0
SK 이노베이션	179,500	-4.27	148.1	42.2	18,593	-399	0.05%	-2,254	2,942	-715	-2,047	1,094
한국조선해양	77,800	0.65	6.3	40.3	6,545	118	0.51%	-268	13	257	107	150

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터