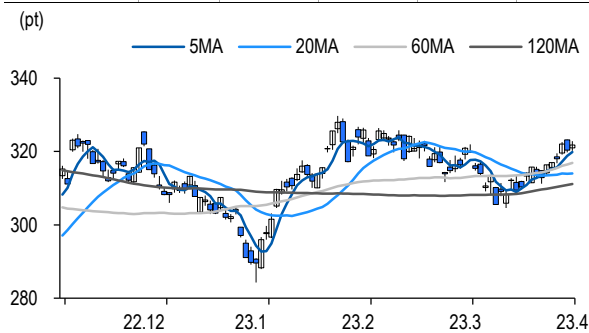


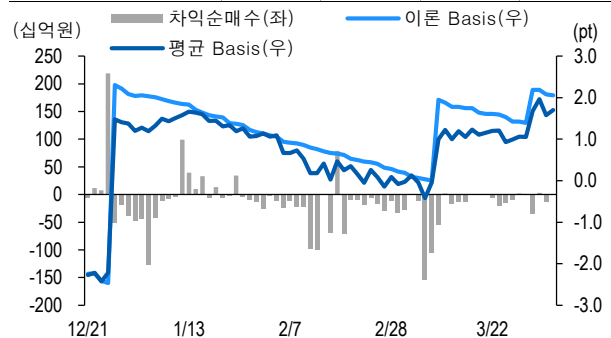
선물옵션시장 지표

2023.4.5

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	321.75	0.43	1.37	8,543.6	-
선물 6월물	323.70	0.50	1.60	17,560.9	318,675
선물 9월물	324.90	0.43	1.40	14.1	20,217
4월물(mini)	322.10	0.44	1.42	1,339.2	77,226
5월물(mini)	322.78	0.43	1.38	6.8	9,540



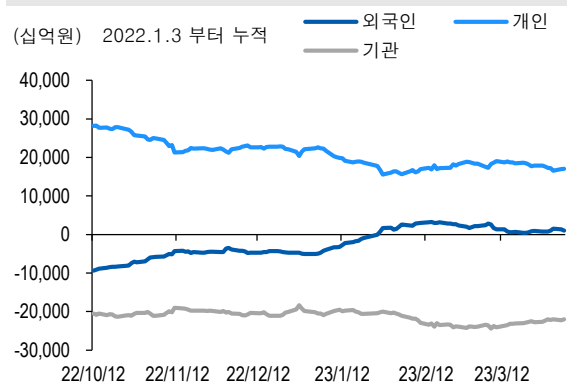
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.06	1.70	1.95	-0.11%
베이스(mini)	0.28	0.26	0.35	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.02	1.44	1.45	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	0.28	0.38	0.38	0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-311.0	-29.9	-341.0	0.1	-104.0	661.6	-27.3	0.1	-2.6	32.4
개인	80.0	27.0	107.0	0.0	-3.8	-240.0	-10.4	-1.0	0.0	27.9
기관	215.0	9.3	224.2	-0.9	21.2	-405.0	37.4	1.0	2.7	-59.8
금융투자	256.1	-21.2	234.9	-0.2	2.5	-684.1	36.5	1.0	0.9	-61.8
투신	43.0	-8.0	35.0	0.0	34.4	280.9	0.7	0.0	-0.1	0.6
은행+보험+기타금융	-5.3	40.4	35.2	0.0	-3.1	4.6	0.2	0.0	1.8	0.0
연기금+국가지자체	-69.5	7.8	-61.6	0.0	-23.7	-6.4	0.0	0.0	0.0	1.4
기타법인	16.1	-8.4	7.7	0.0	0.7	-16.5	0.3	-0.1	-0.1	-0.4

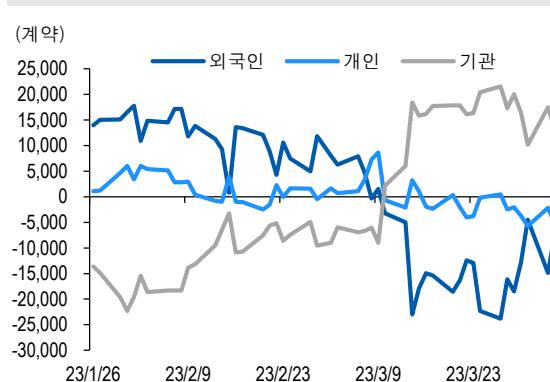
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



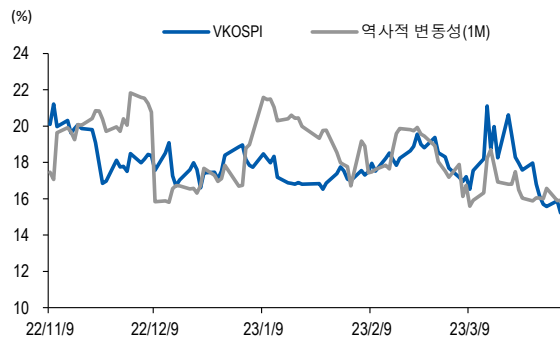
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	608,774	156.0	981,719	13.5%	지수옵션 전체	1,260,673	292.1	2,623,270			
Put	651,899	136.2	1,641,551	14.6%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	15.22%(-0.66%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	0.94	0.06	105,942	29,398	-503	13.4	Put	322.5(K+1)	3.09	-1.12	16,189	6,706	1,003	13.5
	325.0(K+2)	1.75	0.20	102,422	29,747	-2,949	14.0		320.0(K+0)	2.08	-0.84	60,721	17,529	1,662	14.2
	322.5(K+1)	2.70	0.24	49,003	20,644	702	13.7		317.5(K-1)	1.30	-0.67	76,213	14,101	1,135	14.5
	320.0(K+0)	4.21	0.54	14,650	27,815	-1,872	14.5		315.0(K-2)	0.76	-0.50	112,155	23,277	2,084	14.7
	317.5(K-1)	5.98	0.71	1,623	20,905	142	15.1		312.5(K-3)	0.42	-0.37	99,125	22,432	3,479	14.9

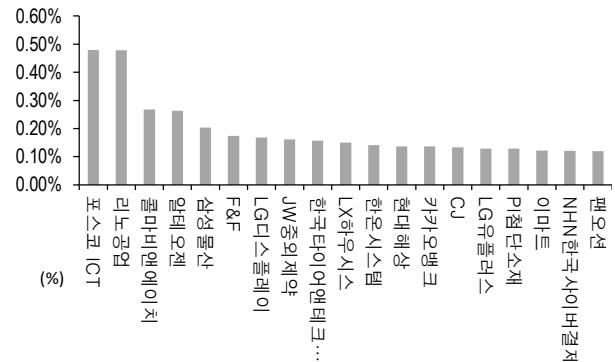
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,358,108	2,894.8	4,646,404	46,965	125,427	11,162	-135,586	32.4	27.9	-59.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	8,260	0.73	2.5	104.9	15,180	7,128	-0.47%	-8,562	329	8,233	8,233	0
현대차	184,000	-0.11	59.0	62.9	31,579	-1,648	-0.02%	-1,849	-814	2,657	2,289	368
삼성전자	63,500	0.16	408.5	58.0	1,145,056	-2,169	0.03%	10,062	2,900	-12,665	-12,616	90
JW 중외제약	21,100	0.00	0.9	54.1	2,112	-682	0.16%	-369	-32	401	401	0
LG 화학	722,000	1.26	139.5	53.1	7,913	788	0.00%	-320	845	-552	-476	-78
SK 하이닉스	85,100	-2.63	381.4	50.9	224,165	39,730	0.11%	15,735	32,250	-48,271	-49,594	-1,618
현대건설	37,400	-0.80	8.4	46.1	16,863	3,341	-0.01%	233	-42	-169	-54	-103
SK 이노베이션	182,000	1.11	116.5	43.7	18,006	-1,264	0.03%	-789	-624	1,389	1,265	137
삼성 SDI	727,000	-2.55	66.3	43.3	12,113	-80	-0.02%	-87	-226	329	198	212
포스코퓨처엠	283,000	-2.08	171.8	40.6	17,723	696	0.03%	502	-1,540	937	98	272

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터