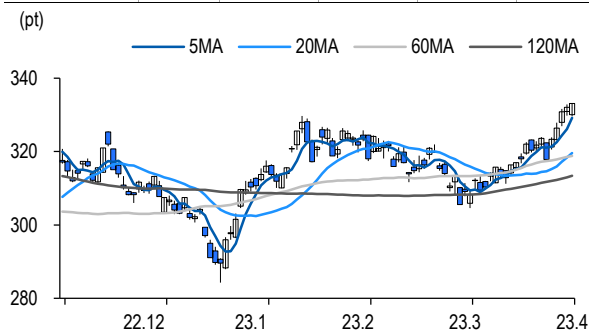


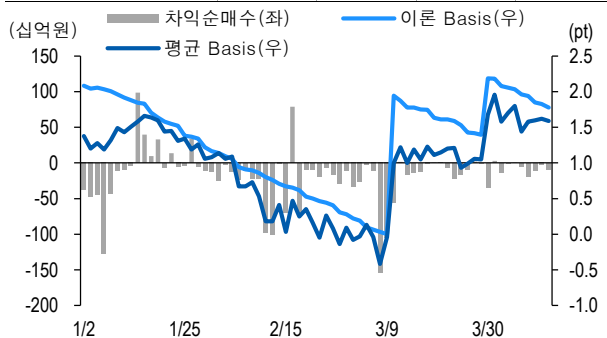
선물옵션시장 지표

2023.4.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	333.09	0.30	1.00	8,487.9	-
선물 6월물	334.30	0.25	0.85	20,011.0	320,151
선물 9월물	335.75	0.25	0.85	21.3	21,281
4월물(mini)	331.16	-0.22	-0.74	836.5	0
5월물(mini)	333.48	0.22	0.74	882.0	31,409



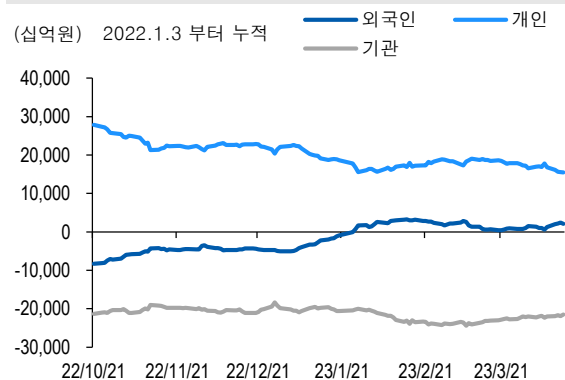
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.75	1.52	1.21	-0.07%
베이스(mini)	0.00	0.02	-1.93	0.01%
제1스프레드(SP)	2.02	1.46	1.45	-0.17%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-1.94	-1.94	-0.58%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-346.3	25.0	-321.4	11.4	-286.5	-2.1	49.9	-3.1	0.8	-4.9
개인	-173.4	39.3	-134.2	0.0	2.6	-71.6	3.3	0.8	-1.7	4.7
기관	496.8	-161.4	335.4	14.5	313.7	-1.2	-57.5	2.0	0.9	-5.7
금융투자	442.3	-149.8	292.5	14.5	261.0	114.5	-59.5	1.1	0.7	33.5
투신	69.8	-10.2	59.6	0.0	64.5	-148.4	-2.6	0.6	0.1	5.4
은행+보험+기타금융	-2.7	16.2	13.6	0.0	0.0	9.1	4.6	0.3	0.2	1.6
연기금+국가지자체	-8.7	-14.6	-23.3	-0.1	-8.4	23.6	0.0	0.0	0.0	-46.2
기타법인	22.9	1.7	24.7	0.0	0.6	74.9	4.4	0.3	0.0	5.9

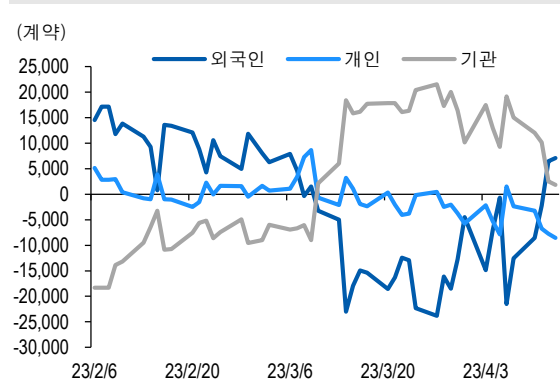
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



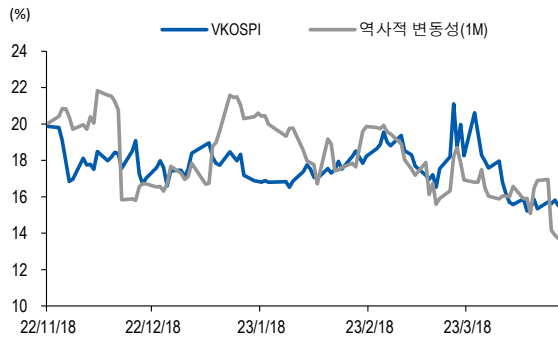
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,872,887	345.8	640,647	5.0%	지수옵션 전체	3,687,727	574.8	1,599,714
Put	1,814,840	229.1	959,067	16.0%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	15.52%(-0.30%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	0.01	0.00	3,009	0	-40,007	16.8	Put	335.0(K+1)	3.91	0.51	45,919	0	-6,714	41.2
	337.5(K+2)	0.01	-0.06	105,849	0	-64,057	11.4		332.5(K+0)	1.39	-0.29	395,650	0	-19,745	24.2
	335.0(K+1)	0.01	-0.34	405,573	0	-39,298	5.6		330.0(K-1)	0.04	-0.58	849,602	0	-29,644	11.0
	332.5(K+0)	0.04	-1.13	870,341	0	-37,301	4.5		327.5(K-2)	0.01	-0.16	296,151	0	-39,259	14.3
	330.0(K-1)	1.21	-1.38	289,346	0	-25,927	3.8		325.0(K-3)	0.01	-0.03	57,488	0	-51,916	19.8

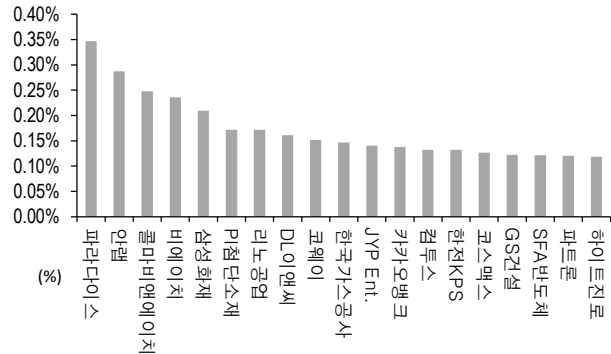
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,843,155	4,474.8	3,742,446	-1,113,369	16,522	-9,350	-18,491	-4.9	4.7	-5.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
카카오페이	54,100	0.37	8.6	40.8	0	-26,628	0.11%	665	426	-1,088	-315	-936
한샘	49,650	3.65	2.3	32.0	0	-12,539	-0.04%	-404	37	373	377	-4
현대차	197,800	0.00	51.0	31.3	0	-11,000	-0.02%	-1,034	343	681	1,578	-1,420
롯데에너지	69,000	1.77	10.9	29.5	0	-21,161	-0.04%	788	-1,746	972	3,541	-2,567
삼성전자	65,600	-0.46	262.6	27.3	0	-373,153	-0.07%	-14,482	-3,007	17,763	25,790	-10,050
에코프로비엠	265,000	-4.16	329.3	26.5	0	-36,513	-0.10%	-646	9,898	-8,885	-8,328	0
LG 에너지솔루션	594,000	1.02	58.9	25.9	0	-7,983	-0.11%	-457	-1,414	1,926	2,287	-368
삼성 SDI	763,000	0.00	50.2	23.8	0	-11,293	-0.12%	-197	15	195	430	-135
포스코퓨처엠	297,500	-1.98	78.1	23.1	0	-12,569	-0.09%	-288	-355	643	742	-299
씨젠	26,450	-1.31	3.5	22.2	0	-25,136	0.05%	-1,014	140	873	-907	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터