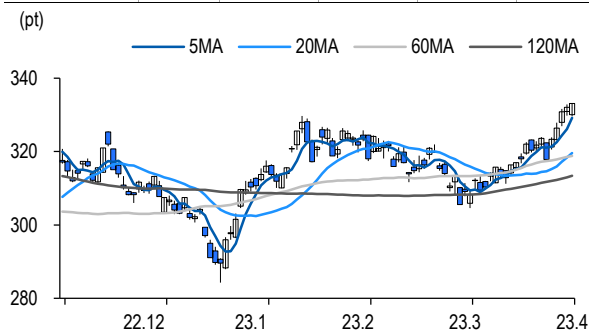


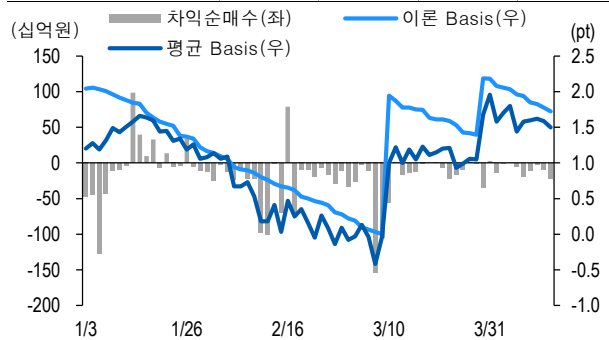
선물옵션시장 지표

2023.4.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	333.68	0.18	0.59	9,210.6	-
선물 6월물	335.20	0.27	0.90	20,218.8	321,596
선물 9월물	336.80	0.31	1.05	33.4	21,874
4월물(mini)	334.44	0.29	0.96	1,878.9	38,660
5월물(mini)	335.00	0.21	0.92	10.7	9,333



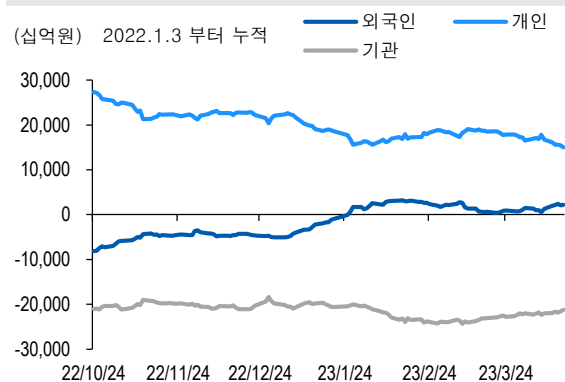
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.72	1.50	1.52	-0.07%
베이스(mini)	0.85	0.72	0.76	-0.04%
제1스프레드(SP)	1.99	1.50	1.50	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.85	0.75	0.75	-0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	166.9	9.7	176.6	0.2	225.8	-136.6	-215.8	-11.8	-9.9	6.5
개인	-410.2	-40.9	-451.1	0.0	-1.4	476.2	7.7	0.7	13.2	65.3
기관	239.5	74.1	313.6	-22.0	-77.3	-349.8	205.2	10.9	-2.4	-77.6
금융투자	228.8	96.5	325.3	-21.6	4.2	-193.0	205.9	4.7	2.1	-57.4
투신	-61.6	-9.7	-71.3	0.0	-35.7	-151.6	-0.7	1.2	-0.1	-0.4
은행+보험+기타금융	-10.1	7.6	-2.5	0.0	-18.3	3.9	0.0	5.0	-4.3	0.0
연기금+국가지자체	73.6	-19.9	53.8	0.0	-13.2	-9.0	0.0	0.0	0.0	-19.8
기타법인	3.8	-36.2	-32.4	0.0	-1.3	10.2	2.9	0.2	-0.9	5.8

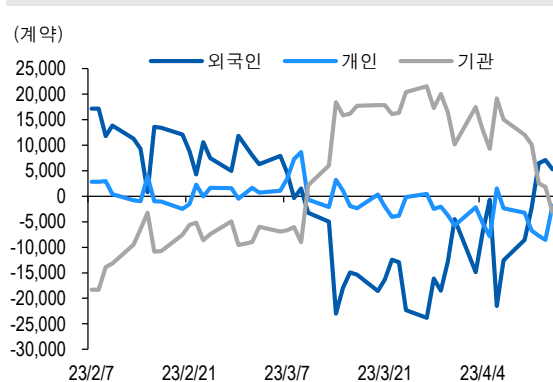
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



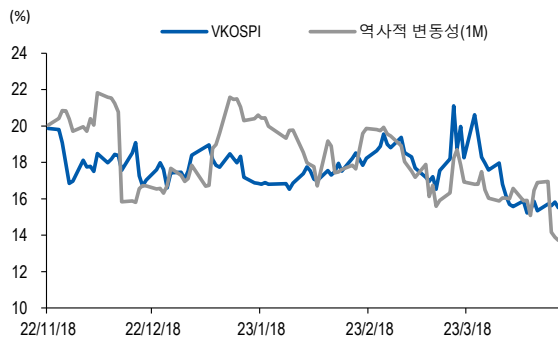
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	492,119	168.0	695,379	13.8%	지수옵션 전체	995,595	329.4	1,782,301
Put	503,476	161.4	1,086,922	14.9%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	15.42%(-0.10%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	2.87	0.23	28,502	15,710	2,201	13.8	Put	335.0(K+1)	5.65	-0.44	25,018	13,186	12,632	14.7
	337.5(K+2)	3.82	0.33	12,024	6,678	1,103	13.9		332.5(K+0)	4.38	-0.50	7,784	4,397	1,979	14.5
	335.0(K+1)	5.01	0.47	12,363	13,905	2,172	14.2		330.0(K-1)	3.43	-0.42	22,410	7,796	4,205	14.8
	332.5(K+0)	6.31	0.45	2,984	9,658	539	14.2		327.5(K-2)	2.63	-0.37	29,583	5,395	4,069	14.9
	330.0(K-1)	7.60	0.26	2,429	12,849	552	13.7		325.0(K-3)	2.00	-0.34	35,546	9,992	2,938	15.1

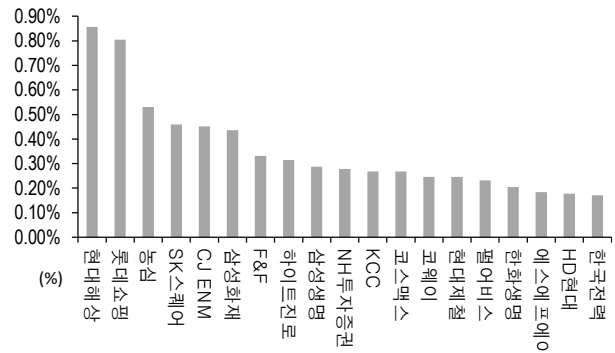
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	77,281	93,026	-175,793	6.5	65.3	-77.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	65,500	-1.21	691.6	67.9	1,093,352	-1,072	0.08%	31,342	17,194	-49,075	-43,231	-6,350
현대차	196,700	-1.21	87.5	66.1	32,761	1,204	-0.03%	-2,350	1,115	1,059	892	167
SK 하이닉스	89,400	0.56	126.8	61.2	189,519	-13,768	-0.08%	-12,118	-2,869	14,424	12,116	2,551
현대건설	39,650	1.02	13.6	60.6	7,187	392	-0.03%	224	342	-576	-470	-106
SK 이노베이션	190,500	-0.99	76.8	60.4	12,788	-466	0.01%	1,051	1,278	-2,428	-1,364	-628
영진약품	3,145	0.96	1.3	53.8	19,155	8,011	0.10%	1,720	5,495	-7,215	-7,215	0
현대제철	36,700	1.80	10.9	52.1	17,030	2,387	0.25%	3,818	-160	-3,681	-3,380	-301
삼성전기	154,400	0.65	29.8	51.8	9,227	1,088	-0.14%	-2,407	735	671	475	196
미래에셋증권	6,990	1.16	3.0	49.9	49,756	9,369	0.00%	6,094	599	-6,693	-6,093	-600
LG 화학	804,000	-0.12	142.1	49.9	8,321	576	0.04%	-383	777	-402	-106	-296

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터