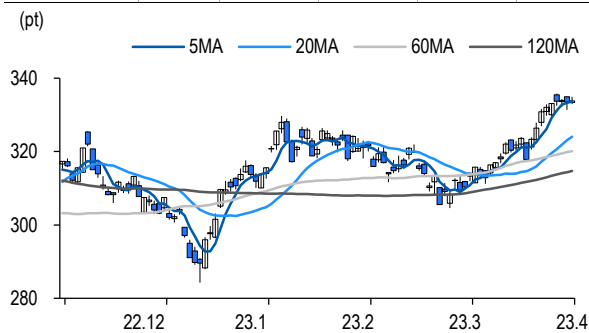


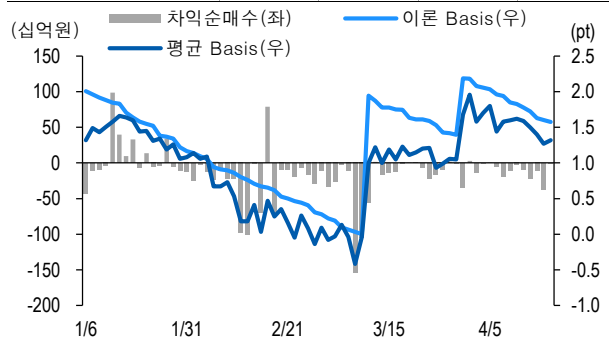
## 선물옵션시장 지표

2023.4.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	333.77	0.08	0.27	7,818.0	-
선물 6월물	335.10	-0.01	-0.05	14,385.7	323,163
선물 9월물	336.50	-0.01	-0.05	12.8	22,680
5월물(mini)	334.32	-0.02	-0.08	1,177.9	46,398
6월물(mini)	335.00	-0.05	0.00	5.6	9,389



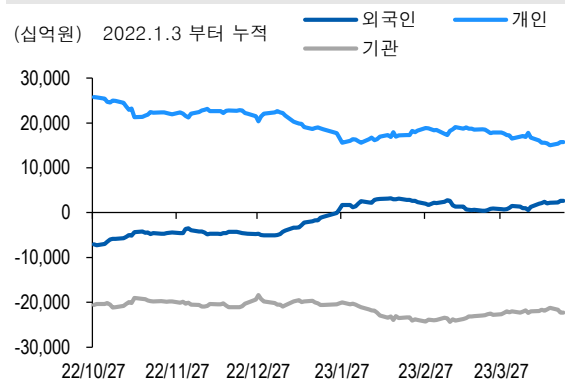
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.58	1.32	1.33	-0.08%
베이스(mini)	0.69	0.56	0.55	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.01	1.54	1.55	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.69	0.52	0.52	-0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-19.7	20.2	0.5	0.0	-10.0	535.1	-53.5	-2.3	0.1	-14.8
개인	-36.9	11.8	-25.1	0.0	-5.6	-150.3	15.6	-0.7	1.1	-13.2
기관	44.9	-46.5	-1.6	-0.6	-61.2	-350.3	37.3	3.1	-1.1	29.0
금융투자	50.0	64.2	114.2	-0.3	4.1	-382.5	36.4	1.8	0.0	35.0
투신	-10.2	7.4	-2.7	0.0	-22.8	60.4	0.8	0.0	0.0	-3.0
은행+보험+기타금융	-12.0	-8.7	-20.7	0.0	-8.4	-20.9	0.1	1.3	-1.2	-0.2
연기금+국가자재	46.1	-109.9	-63.7	0.0	-1.5	-7.4	0.0	0.0	0.0	-2.8
기타법인	11.6	0.7	12.3	0.0	-0.2	-34.5	0.6	-0.1	-0.1	-1.0

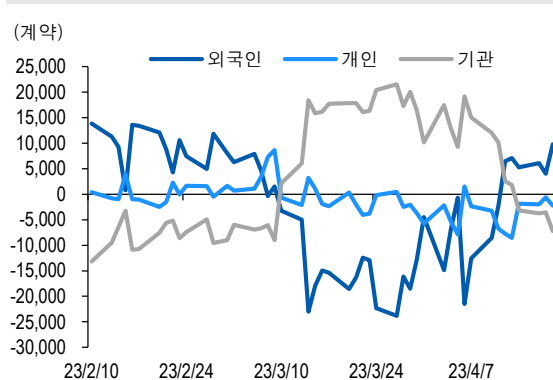
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

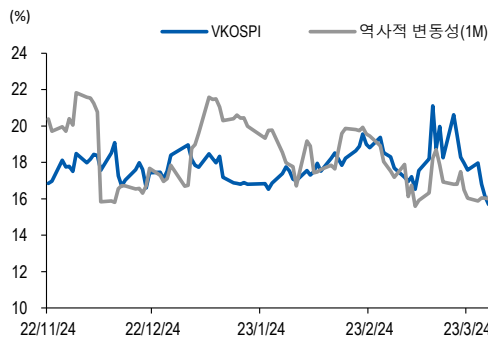
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	433,620	126.4	760,897	13.0%	지수옵션 전체	841,953	229.7	2,030,642
Put	408,333	103.3	1,269,745	14.3%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	14.86%(-0.31%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	2.19	-0.26	47,824	16,983	1,293	13.1	Put	335.0(K+1)	4.88	-0.20	9,842	15,458	1,597	13.8
	337.5(K+2)	3.08	-0.26	16,826	9,593	760	13.2		332.5(K+0)	3.71	-0.20	8,388	6,634	1,008	13.9
	335.0(K+1)	4.18	-0.26	11,194	17,873	696	13.2		330.0(K-1)	2.78	-0.19	21,818	13,449	901	14.1
	332.5(K+0)	5.50	-0.29	3,108	9,452	319	13.3		327.5(K-2)	2.04	-0.17	34,312	8,537	791	14.3
	330.0(K-1)	7.08	-0.28	902	13,104	65	13.5		325.0(K-3)	1.46	-0.15	37,678	14,540	67	14.5

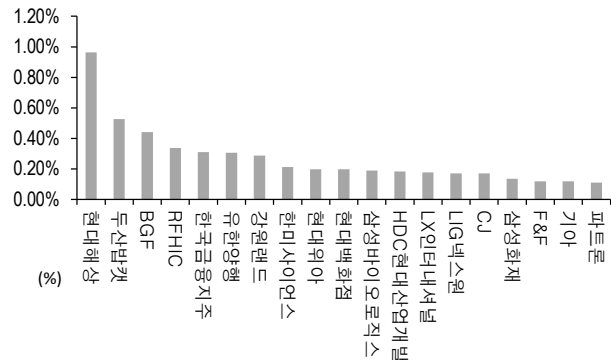
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,087,952	2,802.6	4,313,899	103,224	3,225	-31,143	28,793	-14.8	-13.2	29.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	194,400	1.41	98.7	89.9	41,538	5,264	0.10%	1,887	3,106	-4,963	-3,437	-1,526
삼성전자	65,600	-0.30	498.6	74.3	1,108,929	11,821	0.03%	4,084	-13,672	9,557	11,024	-1,350
SK 하이닉스	88,200	0.23	116.8	66.1	190,891	-136	-0.03%	2,635	-5,415	2,860	3,588	-399
현대건설	39,600	0.64	12.7	62.7	13,590	2,929	-0.02%	-676	-53	729	1,402	-668
넥센타이어	8,740	1.51	0.6	58.9	3,842	268	0.02%	1,227	-198	-1,029	-1,029	0
롯데에너지	67,800	1.04	14.2	55.5	51,693	1,056	0.10%	712	498	-1,158	-582	-576
하나금융지주	42,300	0.48	14.0	50.6	56,559	1,374	0.02%	-313	727	-457	-580	123
포스코퓨처엠	414,000	8.52	544.0	48.3	25,796	3,690	-0.14%	-6,046	-3,701	9,866	8,898	730
LG 유플러스	11,300	0.44	3.9	48.2	35,430	3,692	0.05%	3,360	-2,332	-850	-850	0
현대모비스	227,500	0.66	14.3	46.7	8,182	143	0.06%	289	-300	-5	-90	156

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터