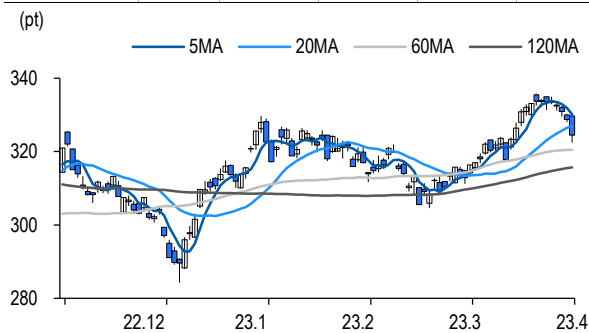


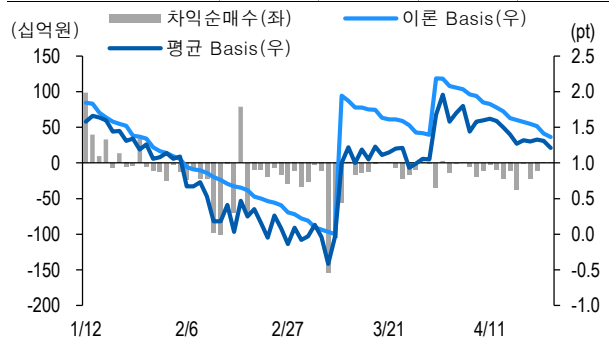
선물옵션시장 지표

2023.4.26

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	324.48	-1.28	-4.22	8,867.5	-
선물 6월물	325.75	-1.27	-4.20	25,137.6	325,505
선물 9월물	327.25	-1.27	-4.20	40.9	21,955
5월물(mini)	325.18	-1.23	-4.04	2,106.7	57,475
6월물(mini)	325.90	-1.23	-4.04	10.3	9,354



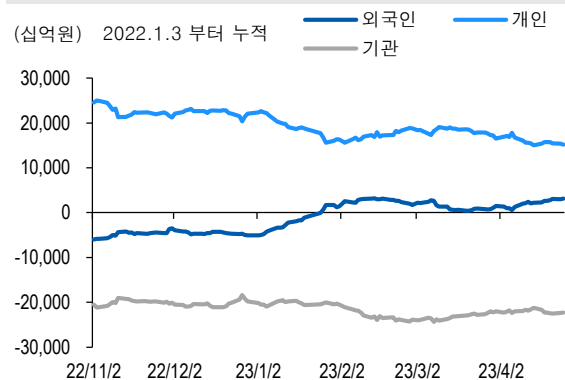
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.37	1.21	1.27	-0.05%
베이스(mini)	0.50	0.53	0.70	0.01%
제1스프레드(SP)	1.96	1.52	1.50	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.50	0.67	0.67	0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-37.3	-6.6	-43.9	0.0	0.3	103.5	81.5	-2.2	16.4	-8.6
개인	-82.0	-33.7	-115.7	0.0	10.9	51.5	18.5	-0.5	-15.5	-39.4
기관	104.1	42.2	146.2	-0.2	-70.1	-130.8	-99.6	3.0	-0.7	50.6
금융투자	248.5	48.2	296.7	0.0	-9.1	-18.9	-96.6	1.5	-0.5	65.8
투신	-76.7	-35.4	-112.1	0.0	-44.7	-92.1	-1.5	-0.3	-0.1	-12.8
은행+보험+기타금융	-4.2	24.4	20.2	0.0	-0.2	-43.0	-1.5	1.8	-0.2	0.0
연기금+국가자재	-38.8	5.1	-33.7	0.1	-6.3	23.3	0.0	0.0	0.0	-2.4
기타법인	15.2	1.9	17.1	0.0	0.8	-24.2	-0.3	-0.3	-0.1	-2.6

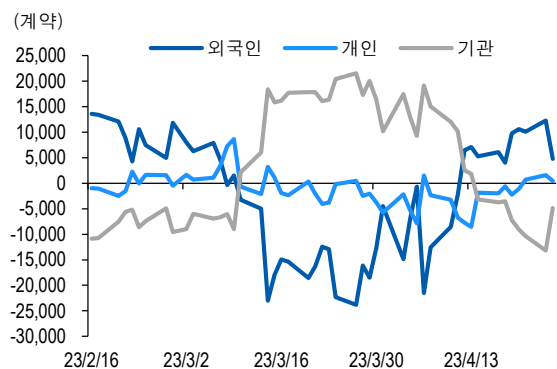
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

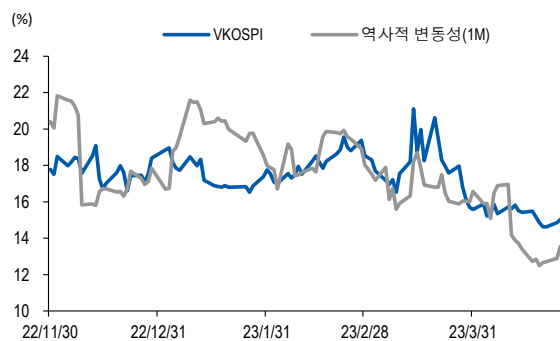


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향												(계약, 십억원)			
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	882,287		215.9		890,720		12.9%		지수옵션 전체	1,767,600		471.2		2,258,846	
Put	885,313		255.4		1,368,126		13.6%		PCR(금액기준)	1.18		VKOSPI		15.02%(+0.16%p)	
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	335.0(K+3)	0.63	-0.87	120,453	31,930	6,464	12.8	Put	330.0(K+1)	6.59	2.41	13,741	16,837	802	12.6
	332.5(K+2)	1.07	-1.25	101,978	20,371	5,873	12.9		327.5(K+0)	5.00	1.97	27,193	11,789	431	12.9
	330.0(K+1)	1.75	-1.63	82,545	23,766	9,223	13.2		325.0(K-1)	3.68	1.52	45,362	15,446	1,086	13.2
	327.5(K+0)	2.65	-2.03	45,724	8,320	4,265	13.4		322.5(K-2)	2.65	1.13	70,796	13,596	-1,652	13.5
	325.0(K-1)	3.80	-2.55	18,702	9,675	3,631	13.6		320.0(K-3)	1.85	0.81	98,865	18,967	-3,643	13.9

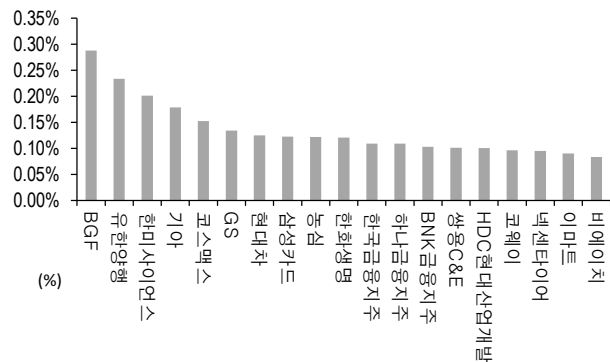
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)											(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	4,182,706	3,646.4	4,372,062	16,659	43,573	27,359	-66,049	25.5	26.0	-50.4		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	63,800	-2.45	819.1	79.4	1,070,063	-19,346	0.07%	15,976	7,204	-22,084	-15,560	-3,625
BGF	4,180	-2.34	0.8	76.4	10,385	-1,704	0.29%	-3,404	28	3,376	3,376	0
JW 중외제약	20,750	-0.24	0.9	71.2	1,236	-902	-0.01%	1,020	-27	-993	-993	0
영진약품	2,935	0.17	0.9	64.8	18,041	-3,896	-0.10%	3,594	-402	-3,192	-3,192	0
롯데에너지	61,100	-3.63	15.6	64.0	43,993	-4,093	-0.13%	446	-5,282	4,893	5,088	-195
현대차	202,000	4.94	255.1	62.5	54,890	8,331	0.13%	1,476	-155	-1,278	-3,541	681
DL 이앤씨	33,050	-0.60	2.6	60.8	6,282	889	0.04%	-1,126	1,496	-296	-276	-20
넥센타이어	8,340	-0.36	0.5	56.4	4,249	-923	0.10%	-1,817	-209	2,026	2,026	0
SK 이노베이션	175,600	-1.84	66.2	53.9	14,383	1,102	0.01%	1,364	258	-1,642	-1,229	-413
포스코퓨처엠	349,000	-4.25	374.0	53.8	23,612	1,171	0.01%	-2,586	4,371	-2,068	-1,383	-638

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터