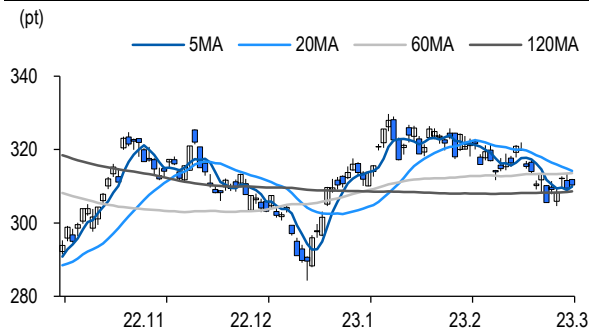


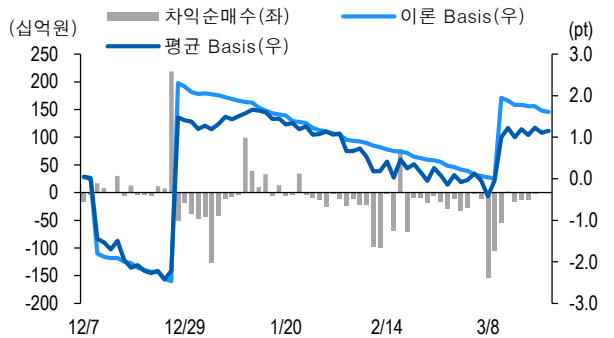
선물옵션시장 지표

2023.3.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	310.36	0.28	0.87	4,117.3	-
선물 6월물	311.85	0.60	1.85	16,597.9	304,535
선물 9월물	313.05	0.34	1.05	132.5	19,632
4월물(mini)	310.50	0.58	1.78	1,075.6	70,463
5월물(mini)	310.90	0.27	0.84	2.3	7,345

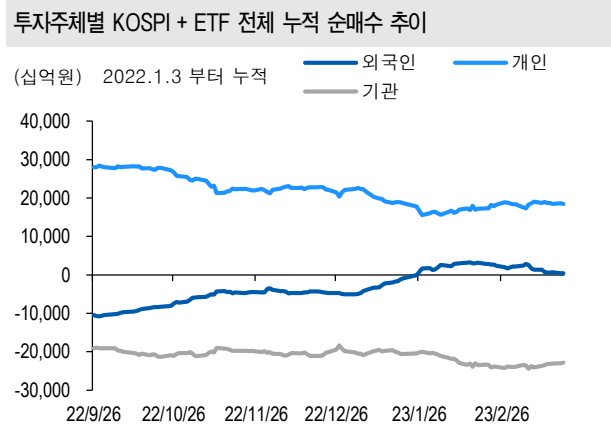


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.61	1.15	1.49	-0.15%
베이스(mini)	-0.11	-0.14	0.14	-0.01%
제1스프레드(SP)	1.93	1.36	1.35	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	-0.11	0.14	0.14	0.08%

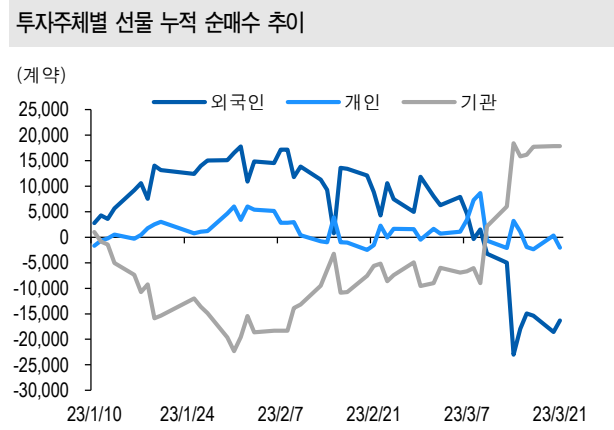


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-55.3	39.6	-15.7	0.1	56.2	131.4	41.4	1.0	-0.3	-4.5
개인	-83.9	-46.2	-130.2	0.0	0.2	-165.7	-17.0	-0.6	0.7	14.7
기관	114.0	10.9	124.9	-0.4	-0.3	27.0	-26.0	0.0	-0.5	-10.1
금융투자	86.3	-43.9	42.4	0.0	8.0	-249.1	-26.4	-1.6	1.2	-12.4
투신	27.2	36.9	64.1	0.0	9.6	291.9	0.3	-0.2	0.0	-1.2
은행+보험+기타금융	14.8	26.9	41.7	0.0	2.6	-13.1	0.1	1.8	-1.6	0.1
연기금+국가자자체	-2.1	-10.7	-12.8	0.1	-16.7	-2.6	0.0	0.0	0.0	3.4
기타법인	25.2	-6.0	19.2	0.0	0.0	7.3	1.6	-0.4	0.1	-0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

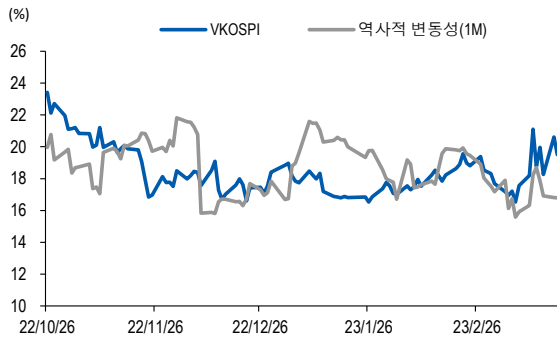
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	446,107	179.4	835,638	17.2%	지수옵션 전체	865,134	365.9	2,084,116
Put	419,027	186.5	1,248,478	18.9%	PCR(금액기준)	1.04	VKOSPI	19.51%(-1.11%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	2.66	0.11	28,934	13,925	710	17.3	Put	312.5(K+1)	6.76	-1.40	3,093	4,789	135	17.6
	315.0(K+2)	3.60	0.22	18,820	13,310	141	17.7		310.0(K+0)	5.51	-1.30	10,404	15,971	712	17.9
	312.5(K+1)	4.72	0.31	11,327	6,846	151	18.1		307.5(K-1)	4.47	-1.18	8,673	10,734	76	18.3
	310.0(K+0)	6.01	0.45	8,489	9,639	-182	18.5		305.0(K-2)	3.60	-1.06	16,752	16,622	550	18.7
	307.5(K-1)	7.43	0.22	620	3,946	15	18.8		302.5(K-3)	2.87	-0.94	26,112	17,590	32	19.1

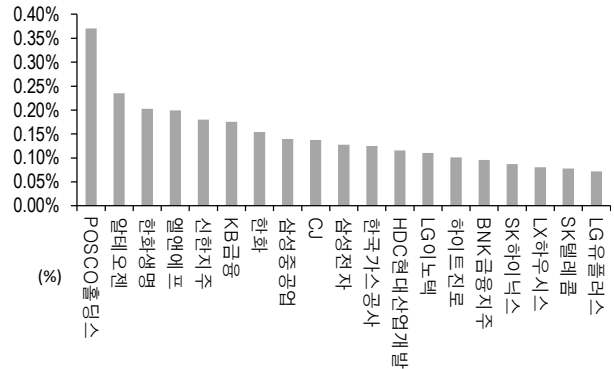
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	2,348,819	1,752.2	4,339,699	11,330	3,534	12,193	-15,533	-4.5	14.7	-10.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한샘	48,900	0.10	1.0	102.2	17,260	-177	-2.84%	-1,135	-83	1,218	1,234	0
현대차	176,100	0.40	45.1	86.2	28,491	-223	-0.06%	-1,195	-355	1,560	1,486	222
삼성전자	60,000	-0.17	403.7	80.4	1,115,206	1,522	0.13%	10,184	18,776	-28,919	-30,513	1,594
SK 하이닉스	83,700	0.24	111.6	70.6	175,424	-1,882	0.09%	4,382	-2,699	-1,581	-1,704	173
한올바이오파마	17,460	1.75	2.0	64.5	5,705	493	-0.43%	-916	218	698	698	0
BGF	4,230	-0.94	0.2	64.3	7,656	-949	-0.12%	-1,811	1,284	527	527	0
영진약품	2,965	-1.17	0.3	62.6	6,951	-2,500	-0.20%	-878	-136	1,014	1,014	0
삼성전기	150,500	0.07	16.9	57.2	11,136	561	-0.07%	-72	124	-51	469	-491
삼성 SDI	714,000	-0.14	81.9	52.5	13,103	463	-0.13%	-1,333	207	1,116	844	274
미래에셋증권	6,520	0.77	1.4	48.8	39,089	-1,222	-0.08%	-3,641	1,764	1,877	1,927	-50

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터