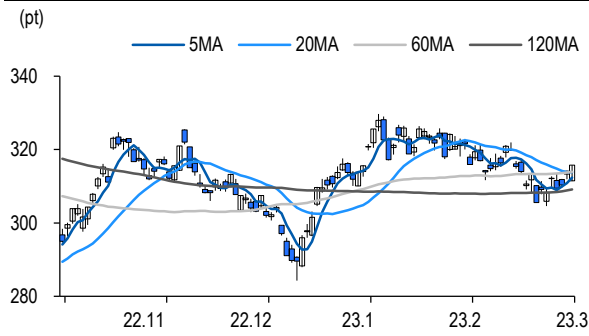


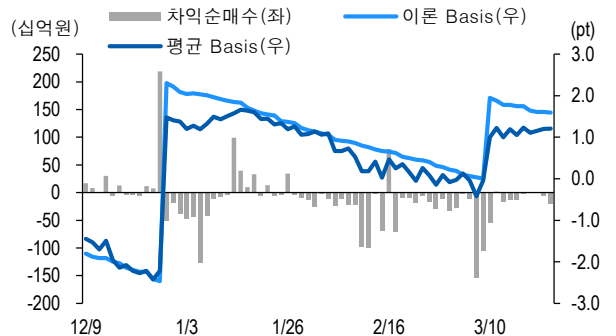
선물옵션시장 지표

2023.3.24

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.75	0.52	1.64	5,783.4	-
선물 6월물	316.10	0.22	0.70	18,842.6	306,170
선물 9월물	317.70	0.30	0.95	16.8	19,629
4월물(mini)	314.78	0.25	0.78	1,458.3	77,594
5월물(mini)	315.26	0.22	0.70	4.6	7,602

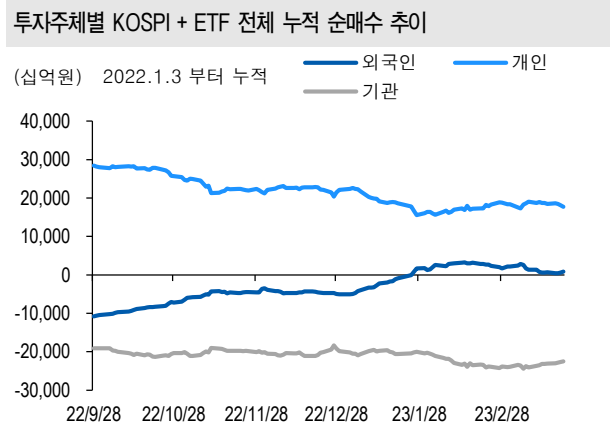


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.59	1.21	0.35	-0.12%
베이스스(mini)	-0.16	-0.17	-0.97	0.00%
제1스프레드(SP)	1.98	1.35	1.45	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.16	-0.92	-0.92	-0.24%

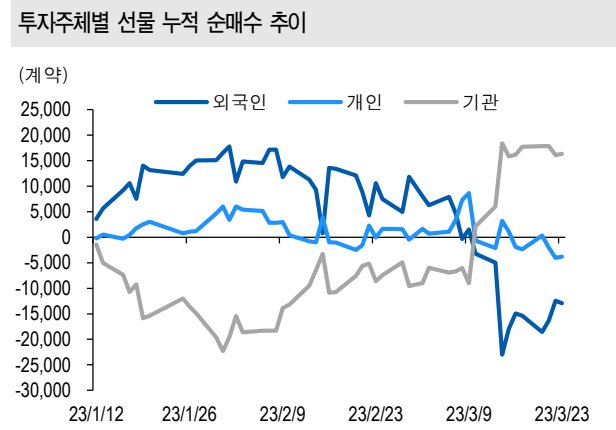


투자주체별 매매 동향 (십억원)											
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	203.1	-5.3	197.8	0.1	99.7	308.7	-2.7	-0.4	-0.6	-6.0	
개인	-347.5	-3.7	-351.2	0.0	-1.9	-155.4	-3.5	0.2	0.7	31.2	
기관	143.2	22.2	165.4	-6.1	-47.9	-141.9	5.0	0.2	-0.1	-28.7	
금융투자	100.1	-14.7	85.4	-2.7	2.4	-405.1	3.6	1.2	-1.0	-37.8	
투신	15.8	-3.7	12.2	0.0	-9.0	233.2	1.4	0.0	-0.1	11.2	
은행+보험+기타금융	16.5	6.3	22.7	0.0	-1.4	28.9	0.0	-1.0	1.0	0.0	
연기금+국가자자체	-10.4	21.9	11.5	0.0	-40.5	1.1	0.0	0.0	0.0	-2.1	
기타법인	1.1	-9.1	-8.0	0.0	1.0	-11.3	1.2	0.0	0.0	3.5	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



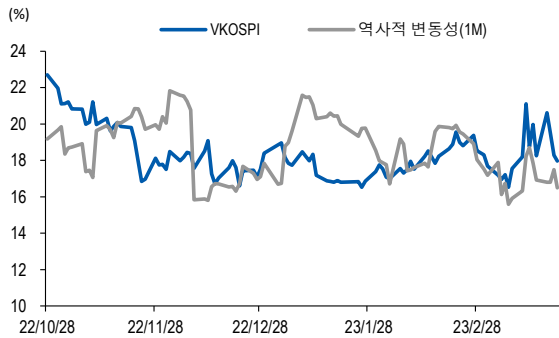
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	511,579	185.0	883,735	14.5%	지수옵션 전체	1,123,662	378.5	2,210,018
Put	612,083	193.5	1,326,283	18.4%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	17.97%(-0.32%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.87	0.05	63,682	17,173	-60	14.4	Put	317.5(K+1)	6.35	-0.71	1,553	3,039	-18	17.3
	320.0(K+2)	2.67	0.07	65,231	27,796	-791	14.6		315.0(K+0)	5.09	-0.64	9,085	10,544	2,003	17.5
	317.5(K+1)	3.69	0.11	26,767	15,165	-196	14.8		312.5(K-1)	4.05	-0.54	11,492	8,182	1,869	17.8
	315.0(K+0)	4.92	0.19	19,830	15,173	1,300	14.9		310.0(K-2)	3.19	-0.46	25,408	17,065	591	18.2
	312.5(K-1)	6.52	0.42	17,406	15,853	8,259	15.6		307.5(K-3)	2.46	-0.42	29,978	13,440	1,788	18.4

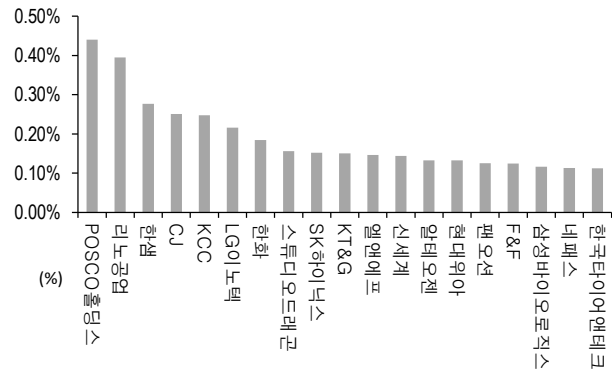
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,210,223	2,818.0	4,294,042	-26,541	-8,273	45,736	-43,588	-15.5	21.9	-13.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
에스엠	86,300	1.89	43.5	124.1	147,062	-5,349	-19.90%	-1,713	575	684	2,805	15
메리츠증권	6,550	-1.80	7.8	98.1	70,624	-2,985	0.02%	-5,076	3,301	1,775	207	0
SK 하이닉스	88,300	1.96	218.5	81.3	180,367	13,697	0.15%	-8,421	16,048	-11,737	-12,969	-1,948
현대차	180,700	0.00	73.7	69.1	32,292	2,287	-0.02%	958	1,552	-2,559	-2,466	-94
한샘	52,400	0.19	2.5	68.9	17,759	-1,252	0.28%	314	712	-1,026	-657	0
삼성전기	151,300	0.33	31.7	67.4	10,274	-629	0.02%	1,421	807	-2,236	-1,936	-300
LG 화학	709,000	0.85	76.7	53.6	7,261	-546	-0.06%	-647	58	589	367	222
삼성전자	61,800	1.48	494.5	52.4	1,083,482	-12,622	-0.02%	-8,387	-1,807	9,861	1,470	8,800
미래에셋증권	6,500	-0.61	2.1	49.9	39,665	-652	-0.08%	-1,267	-483	1,758	1,721	50
삼성 SDI	748,000	2.05	107.0	49.4	12,430	-488	-0.03%	-13	515	-505	-921	398

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터