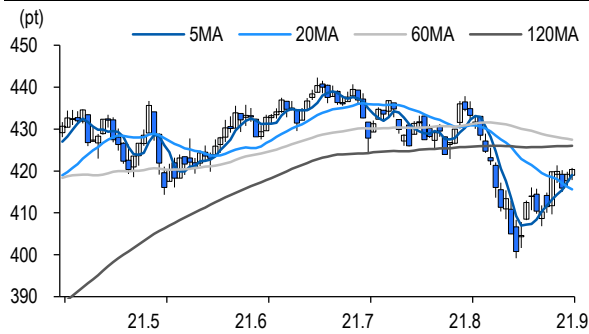


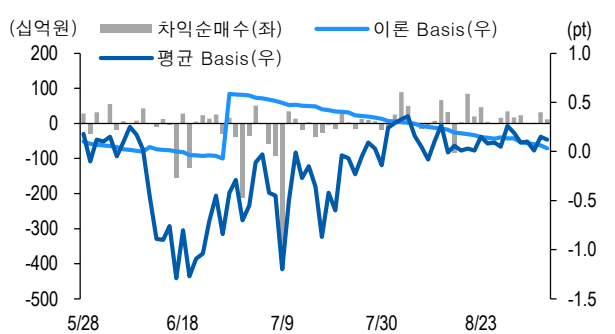
선물옵션시장 지표

2021.9.7

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	420.37	0.27	1.15	7,516.1	-
선물 9월물	420.15	0.24	1.00	25,159.8	204,545
선물 12월물	420.05	0.27	1.15	991.7	86,246
9월물(mini)	420.24	0.26	1.06	1,738.8	48,679
10월물(mini)	420.00	0.33	1.40	18.5	1,647

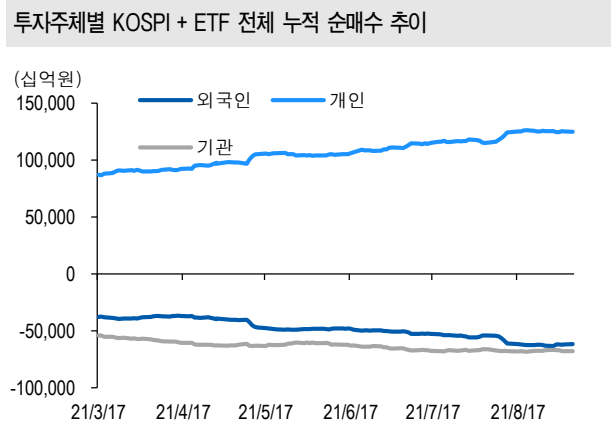


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.03	0.12	-0.22	0.02%
베이스스(mini)	0.03	0.12	-0.13	0.02%
제1스프레드(SP)	0.37	-0.23	-0.15	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	0.03	-0.17	-0.17	-0.05%

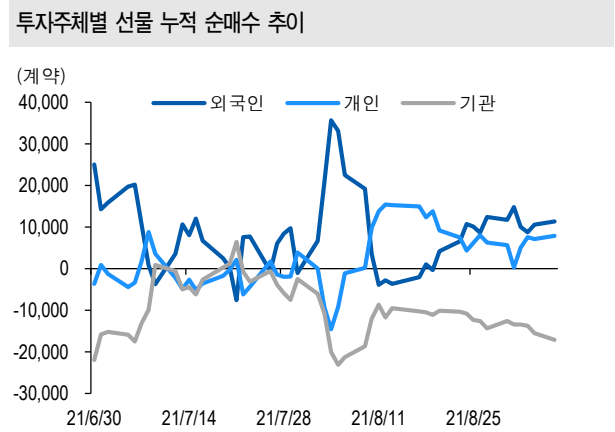


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	63.8	18.4	82.2	0.0	61.3	73.0	6.8	0.0	1.5	-18.9
개인	-97.9	-2.2	-100.1	0.0	-1.3	86.6	-5.3	1.4	-1.7	52.2
기관	45.5	-15.6	29.9	11.8	-30.9	-166.5	0.3	-0.6	1.6	-33.7
금융투자	29.7	-16.8	12.8	1.3	1.4	31.3	0.3	-0.3	1.5	-75.9
투신	-12.3	-4.7	-17.1	0.0	-14.3	-138.7	0.0	-0.4	0.0	63.9
은행+보험+기타금융	15.5	0.9	16.4	0.0	-4.2	-57.9	0.0	0.1	0.0	0.1
연기금+국가자재	-0.3	-1.4	-1.6	0.0	-23.4	-1.2	0.0	0.0	0.0	-21.7
기타법인	-11.5	-0.6	-12.1	0.0	0.1	7.0	-1.7	-0.8	-1.3	0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



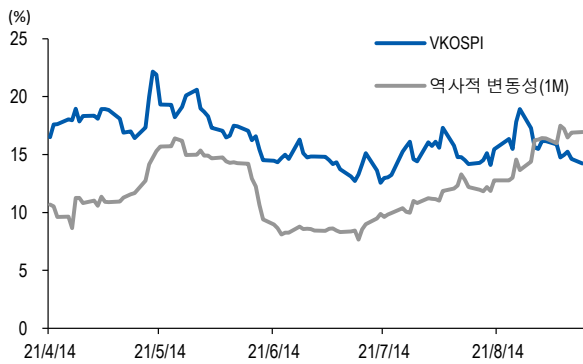
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,788,937	357.2	1,063,638	13.8%	지수옵션 전체	3,331,192	645.3	2,983,783
Put	1,542,255	288.1	1,920,145	15.3%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	14.24%(-0.38%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	427.5(K+3)	0.39	-0.07	296,049	44,026	6,079	14.0	Put	422.5(K+1)	3.81	-1.09	13,299	4,952	1,289	15.0
	425.0(K+2)	0.81	-0.06	335,072	42,581	2,243	13.9		420.0(K+0)	2.40	-1.05	71,954	17,032	2,514	14.8
	422.5(K+1)	1.51	-0.05	250,842	29,554	2,470	13.7		417.5(K-1)	1.39	-0.92	141,449	18,632	6,120	14.8
	420.0(K+0)	2.60	0.03	152,052	27,948	1,060	13.6		415.0(K-2)	0.77	-0.72	245,207	26,565	4,991	15.1
	417.5(K-1)	4.08	0.14	31,160	18,643	-457	13.4		412.5(K-3)	0.40	-0.55	281,356	25,567	5,452	15.5

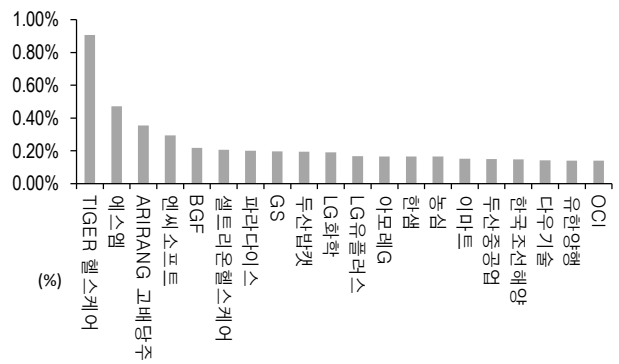
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,617,553	3,120.1	6,185,628	112,473	-30,743	49,816	-18,312	-18.9	52.2	-33.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	77,200	0.92	827.9	83.6	956,115	-111,659	0.05%	-14,095	5,305	8,919	-2,694	-20,461
삼성 SDI	767,000	0.79	82.2	80.1	29,531	-851	0.07%	-425	606	-344	-1,034	692
POSCO	349,500	0.29	72.9	78.0	20,916	-464	0.09%	154	-150	-4	-809	344
NAVER	453,500	0.22	115.7	69.9	48,798	-3,020	0.03%	459	-602	143	-806	932
SK 텔레콤	307,000	0.33	55.2	68.1	20,557	1,222	0.10%	-574	2,121	-1,547	298	-1,732
현대차	215,000	0.00	55.7	67.0	59,858	2,496	0.10%	1,238	-141	-1,096	-573	-523
SK 이노베이션	250,000	-0.20	35.0	66.3	22,996	526	0.05%	-20	920	-898	-226	-656
SK 하이닉스	106,000	-0.93	125.5	63.5	141,291	-1,710	0.07%	-4,974	3,231	1,748	1,713	0
에스엠	65,400	-0.30	23.1	61.7	59,238	9,112	0.47%	2,115	-3,219	1,104	-12,246	0
LG 전자	147,500	-4.22	143.3	60.0	48,904	-4,837	-0.04%	-4,883	6,750	-1,866	-3,773	1,897

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터