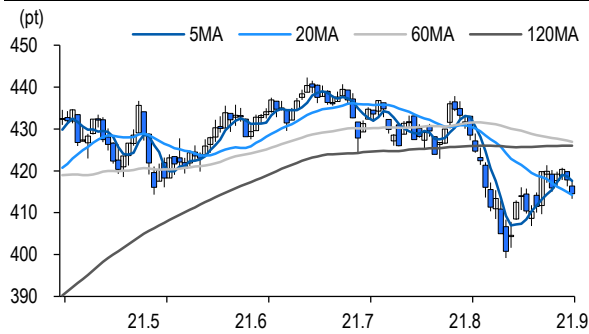


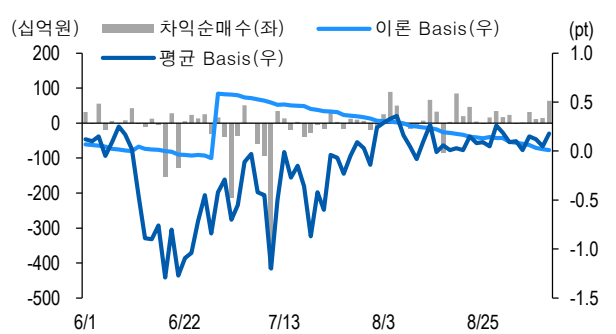
선물옵션시장 지표

2021.9.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	414.54	-0.78	-3.26	11,431.7	-
선물 9월물	414.50	-0.96	-4.00	25,001.1	94,544
선물 12월물	413.70	-0.97	-4.05	4,367.9	223,141
9월물(mini)	414.56	-0.94	-3.74	2,142.8	43,101
10월물(mini)	414.28	-0.89	-3.72	59.1	11,767

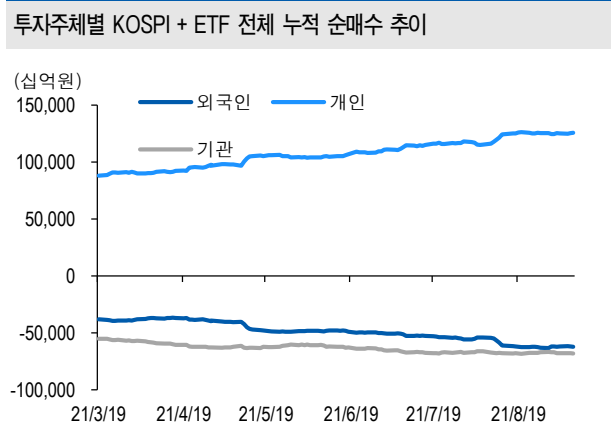


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.01	0.18	-0.04	0.04%
베이스스(mini)	0.01	0.18	0.02	0.04%
제1스프레드(SP)	0.35	0.01	-0.10	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	-0.04	-0.04	-0.01%

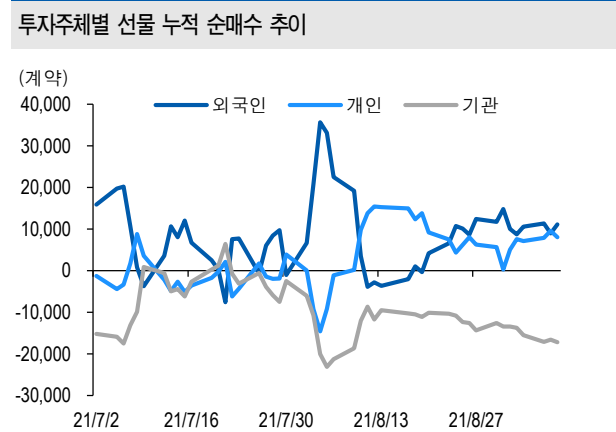


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-283.7	25.2	-258.4	0.1	-89.9	224.8	-1.1	9.1	0.7	10.3
개인	424.4	11.2	435.6	0.0	-4.9	-153.3	-6.7	-8.1	-1.2	-62.8
기관	-119.5	-39.8	-159.2	63.2	71.2	-64.2	3.4	0.8	-0.2	56.0
금융투자	-9.6	-19.5	-29.1	4.0	62.1	151.1	3.9	2.4	0.0	73.1
투신	-3.0	4.8	1.8	16.5	-2.7	-190.8	-0.4	-0.5	0.1	-56.5
은행+보험+기타금융	-13.7	-33.2	-46.9	0.0	7.1	-12.4	-0.2	-1.1	-0.3	0.0
연기금+국가자재	-104.2	1.0	-103.1	10.5	-2.7	-12.0	0.0	0.0	0.0	39.4
기타법인	-21.2	3.3	-17.9	0.0	-0.4	-7.3	4.4	-1.9	0.6	-3.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



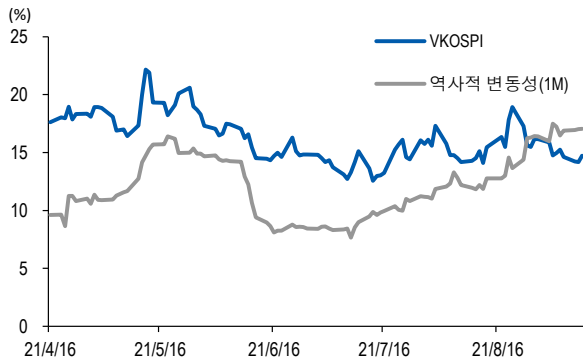
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,191,265	314.8	1,156,776	13.4%	지수옵션 전체	4,531,315	733.6	3,164,548
Put	2,340,050	418.9	2,007,772	13.8%	PCR(금액기준)	1.33	VKOSPI	14.73%(+0.55%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	425.0(K+3)	0.03	-0.18	253,260	44,338	-5,384	15.8	Put	420.0(K+1)	5.62	2.68	25,190	15,497	-1,717	13.4
	422.5(K+2)	0.05	-0.55	422,762	41,285	6,775	13.7		417.5(K+0)	3.45	1.91	111,794	18,222	-1,672	12.7
	420.0(K+1)	0.13	-1.15	514,657	55,578	25,305	12.3		415.0(K-1)	1.80	1.00	315,118	25,414	-1,204	12.8
	417.5(K+0)	0.45	-2.05	406,760	29,436	8,357	12.0		412.5(K-2)	0.78	0.40	460,858	26,302	784	13.1
	415.0(K-1)	1.34	-2.88	190,160	22,352	5,016	12.7		410.0(K-3)	0.33	0.15	500,585	40,266	-5,988	14.3

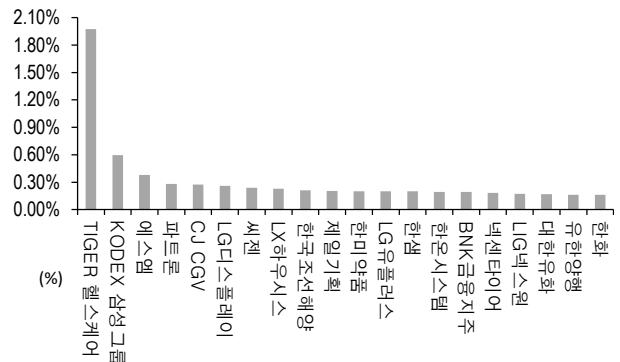
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,807,743	4,993.9	6,508,880	177,944	32,126	-50,487	20,875	10.3	-62.8	56.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	44,150	1.61	34.3	72.0	35,820	-43,172	-0.03%	8,932	-12,314	3,384	2,118	1,269
삼성전기	183,500	0.55	40.6	71.4	12,342	-3,792	-0.06%	221	-811	590	277	313
현대차	213,000	0.00	88.1	70.3	49,306	-5,374	0.11%	3,557	-1,047	-2,511	-1,858	-1,074
삼성전자	76,200	0.13	612.8	70.1	491,555	-197,929	0.01%	-18,678	-17,271	35,974	10,706	25,150
삼성 SDI	769,000	-1.03	121.1	66.8	13,063	-9,237	0.06%	-242	420	-143	-1,068	1,032
SK 이노베이션	252,000	1.00	69.7	63.7	17,090	-4,317	0.03%	1,154	1,313	-2,961	-1,010	-232
POSCO	361,500	0.28	79.3	55.3	16,696	-2,614	0.04%	-1,005	502	506	-558	557
카카오	138,500	-10.06	1,266.6	53.7	94,314	-7,936	-0.18%	-652	-17,861	18,919	34,384	7,310
KT	32,650	0.15	9.9	50.7	31,654	-24,999	0.06%	-90	-2,436	2,527	1,228	1,299
SK 하이닉스	105,500	0.96	153.4	50.4	98,640	-15,059	-0.12%	8,300	-14,444	6,244	3,851	1,010

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터