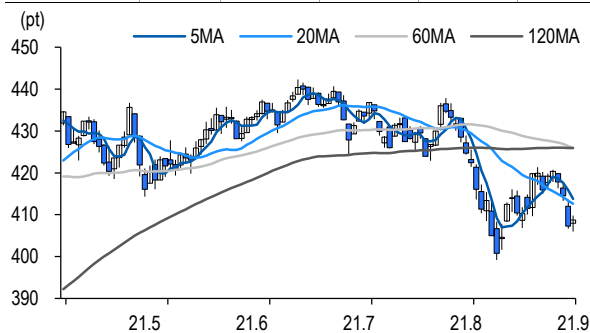


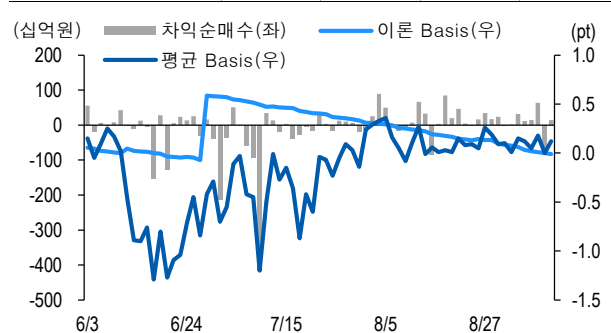
선물옵션시장 지표

2021.9.13

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	408.70	0.35	1.42	9,555.7	-
선물 12월물	408.20	0.43	1.75	26,310.9	252,660
선물 3월물	405.00	0.43	1.75	20.8	8,172
10월물(mini)	407.80	0.20	0.80	1,998.0	28,722
11월물(mini)	407.94	0.35	1.42	1.3	146



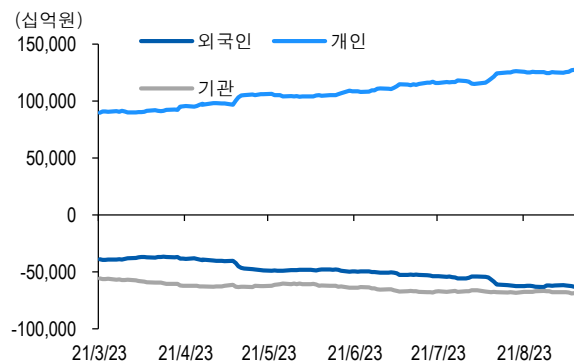
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-0.01	0.12	-0.50	0.03%
베이스(mini)	-0.01	-0.28	-0.90	-0.07%
제1스프레드(SP)	-3.10	-3.53	-3.15	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-0.01	-0.90	-0.90	-0.22%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-518.2	-19.6	-537.8	0.0	-399.1	234.4	-0.6	2.0	-1.7	82.0
개인	280.7	-1.9	278.8	0.0	6.2	-145.3	-13.1	-4.1	-1.8	34.4
기관	238.3	18.0	256.2	14.8	-152.3	61.8	11.9	2.4	3.3	-117.2
금융투자	340.6	82.1	422.8	-1.6	30.7	-153.0	11.8	3.6	3.6	-86.2
투신	11.1	7.4	18.5	0.0	-0.4	260.8	0.0	-0.6	-0.2	27.7
은행+보험+기타금융	5.9	-65.8	-59.9	0.0	2.3	-28.5	0.0	-0.5	0.0	1.0
연기금+국가지자체	-130.9	-6.0	-136.9	16.4	-185.1	-17.5	0.0	0.0	0.0	-59.6
기타법인	-0.8	3.5	2.7	0.0	0.8	-150.9	1.9	-0.3	0.1	0.9

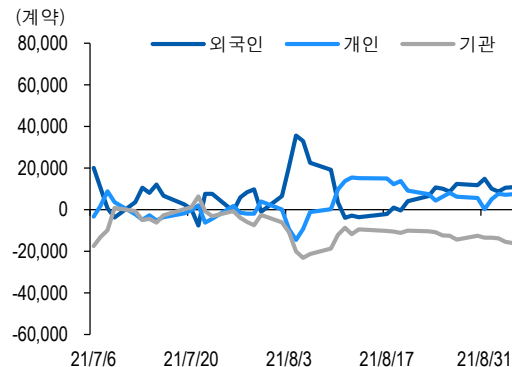
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

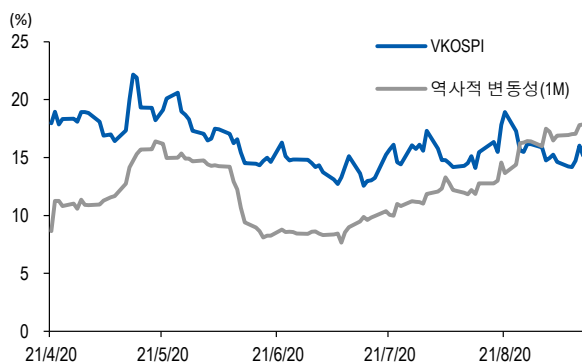


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향													(계약, 십억원)			
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정		
Call	510,739		194.5		529,843		13.0%		지수옵션 전체	1,127,473		442.1		1,394,182		
Put	616,734		247.6		864,339		15.4%		PCR(금액기준)	1.27		VKOSPI		15.18%(−0.84%p)		
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	415.0(K+3)	3.86	0.12	21,637	3,574	926	13.0	Put	410.0(K+1)	8.15	−1.35	3,611	6,233	421	14.6	
	412.5(K+2)	4.81	0.21	10,616	2,940	774	13.1		407.5(K+0)	7.00	−1.19	7,321	3,859	594	14.8	
	410.0(K+1)	5.99	0.30	9,912	3,992	1,101	13.3		405.0(K−1)	5.96	−1.13	5,971	4,183	163	15.1	
	407.5(K+0)	7.30	0.37	6,154	2,447	1,471	13.5		402.5(K−2)	5.08	−1.03	12,595	2,945	346	15.4	
	405.0(K−1)	9.01	0.46	2,176	953	382	14.2		400.0(K−3)	4.30	−0.90	14,909	12,530	−681	15.7	

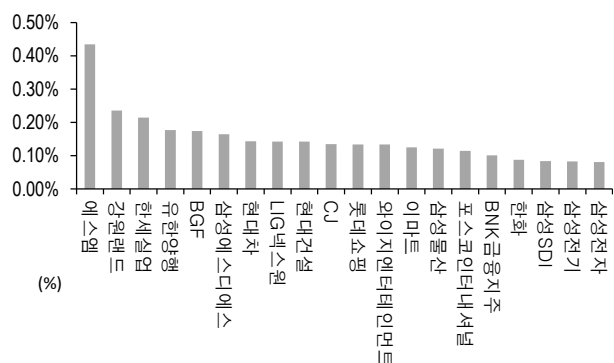
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,217,656	2,987.0	5,278,635	260,079	101,143	87,773	-187,937	82.0	34.4	-117.2		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	5,400	-0.74	1.7	81.7	7,053	2,016	0.00%	-748	114	634	634	0
삼성전자	75,200	0.00	597.0	78.8	1,145,048	15,522	0.08%	42,385	8,705	-51,090	-26,787	-24,689
삼성 SDI	751,000	0.13	96.1	70.8	29,003	651	0.08%	747	768	-1,484	-1,286	-821
SK 이노베이션	250,000	0.81	65.1	68.0	18,577	2,202	-0.01%	3,039	-387	-2,684	-1,789	-835
KT	32,850	0.31	12.4	61.4	62,837	932	0.05%	992	2,593	-3,964	535	-4,499
S-Oil	96,300	-1.03	11.5	59.6	8,646	1,087	-0.08%	693	255	-948	-683	-265
현대건설	53,500	1.13	12.1	59.3	16,332	3,531	0.14%	4,197	246	-4,481	-4,481	0
현대차	206,500	-0.96	80.0	57.5	55,790	2,483	0.14%	2,569	-1,852	-749	2,105	-3,574
삼성증권	49,250	1.13	4.7	56.0	12,638	1,624	0.02%	-168	2,272	-2,103	-1,649	-414
호텔신라	88,200	0.57	8.7	55.5	18,034	738	-0.03%	-958	-313	1,254	1,124	190

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터