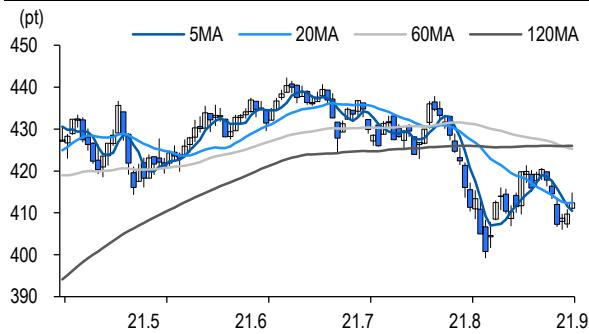


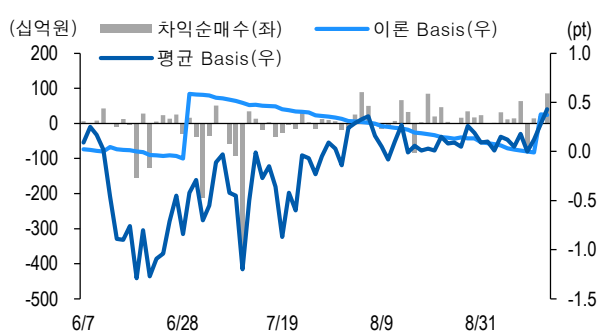
선물옵션시장 지표

2021.9.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.36	0.65	2.66	11,635.8	-
선물 12월물	412.60	0.71	2.90	24,712.1	259,352
선물 3월물	408.80	0.66	2.70	27.9	7,829
10월물(mini)	412.04	0.71	2.90	1,815.8	45,358
11월물(mini)	412.30	0.61	2.50	3.1	1,671

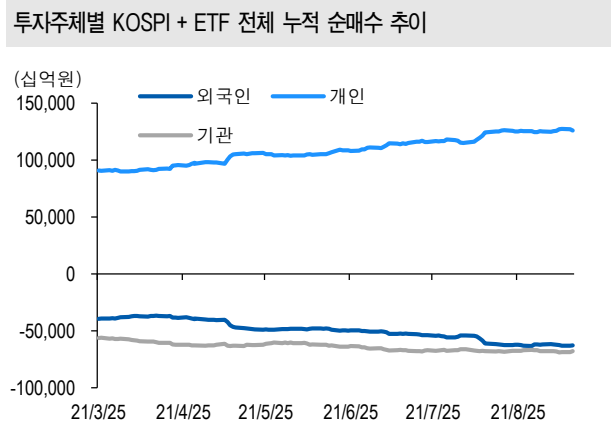


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.37	0.43	0.24	0.01%
베이스스(mini)	-0.26	-0.20	-0.32	0.01%
제1스프레드(SP)	-2.98	-3.71	-3.70	-0.18%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.26	-0.36	-0.36	-0.02%

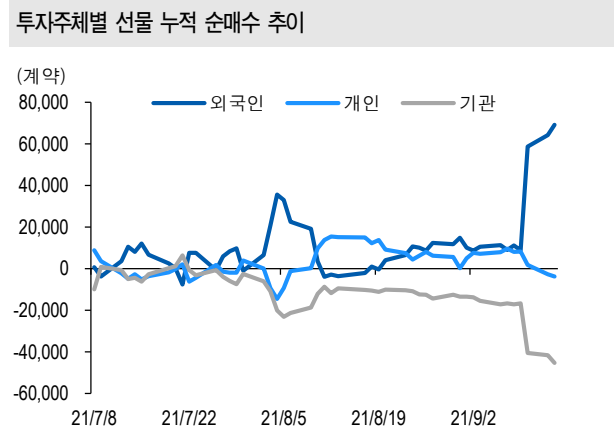


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	293.9	17.5	311.3	-7.7	342.8	639.6	-129.8	-1.1	3.1	-7.7
개인	-1,067.0	-71.6	-1,138.5	0.0	-2.9	-76.2	-27.2	2.7	-2.3	-21.7
기관	764.0	47.0	811.0	93.2	94.3	-546.0	163.5	-1.5	-0.7	29.7
금융투자	584.5	146.7	731.2	95.4	142.9	-740.4	163.5	-1.6	-0.8	-20.7
투신	78.3	-6.2	72.1	0.0	-6.0	196.2	0.0	0.1	0.0	57.7
은행+보험+기타금융	7.9	-77.1	-69.2	2.1	-5.8	-5.1	0.0	0.1	0.1	0.2
연기금+국가자재	-6.9	-10.2	-17.1	-4.3	-45.9	3.3	0.0	0.0	0.0	-7.4
기타법인	9.1	7.1	16.2	0.0	0.0	-17.4	-6.4	-0.1	-0.1	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



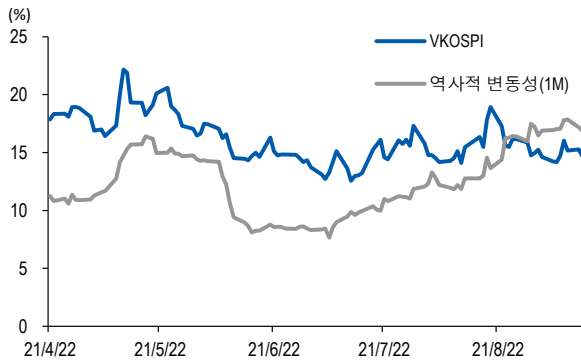
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	611,926	243.8	577,496	12.8%	지수옵션 전체	1,112,711	420.8	1,509,401		
Put	500,785	177.0	931,905	14.7%	PCR(금액기준)	0.73	VKOSPI	14.67%(-0.61%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	417.5(K+3)	3.85	0.68	21,138	6,601	-426	12.8	Put	412.5(K+1)	6.75	-1.73	6,484	2,788	1,061	13.7
	415.0(K+2)	4.93	0.82	14,535	5,252	407	13.0		410.0(K+0)	5.68	-1.57	10,462	7,686	915	14.0
	412.5(K+1)	6.24	1.06	8,261	3,812	604	13.4		407.5(K-1)	4.77	-1.40	7,737	4,540	331	14.3
	410.0(K+0)	7.68	1.24	3,323	5,341	423	13.8		405.0(K-2)	3.96	-1.24	13,726	5,220	420	14.6
	407.5(K-1)	9.26	1.41	1,250	2,636	-162	14.1		402.5(K-3)	3.29	-1.11	14,247	4,076	991	15.0

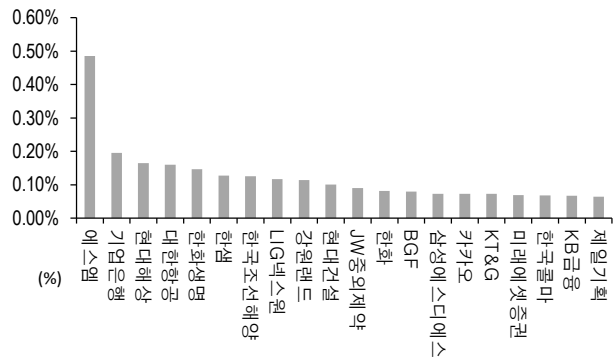
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,211,719	3,766.4	5,457,440	166,180	-13,978	21,034	-15,590	-7.7	-21.7	29.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	76,500	0.66	1,017.8	72.7	1,134,506	-11,683	0.05%	2,961	-15,112	12,151	-4,260	10,899
삼성 SDI	758,000	2.16	103.3	69.7	30,905	821	0.05%	534	179	-748	-433	-762
현대차	209,500	1.95	100.4	66.6	54,898	497	0.04%	503	507	-1,007	-240	-767
현대제철	53,300	-1.66	20.9	58.1	29,524	-1,729	0.00%	-2,723	717	1,999	-524	2,623
POSCO	363,000	-2.42	88.2	58.0	23,819	778	-0.63%	-2,691	1,338	1,264	-320	848
NAVER	402,500	-1.23	331.9	51.4	62,396	-9,816	-0.03%	-345	-9,722	10,387	6,366	3,366
호텔신라	90,500	4.26	30.3	48.9	21,620	-776	0.04%	2,188	276	-2,425	-2,476	-3,514
한국금융지주	88,600	0.80	7.7	48.5	36,138	-596	-0.03%	1,056	-167	-720	-1,105	385
LG 디스플레이	20,350	0.99	18.5	48.4	335,117	-5,838	-0.06%	4,375	-6,311	1,941	-2,393	-4,169
SK 텔레콤	302,500	0.33	20.7	47.7	22,826	13	-0.69%	-578	114	464	6	458

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터