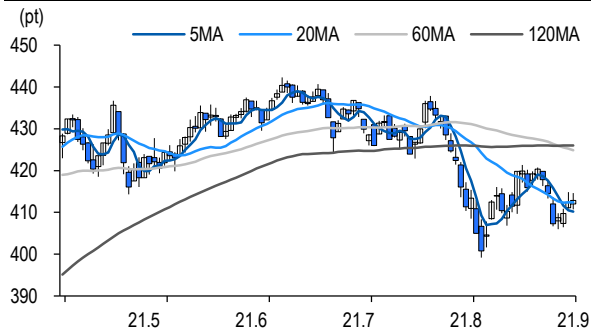


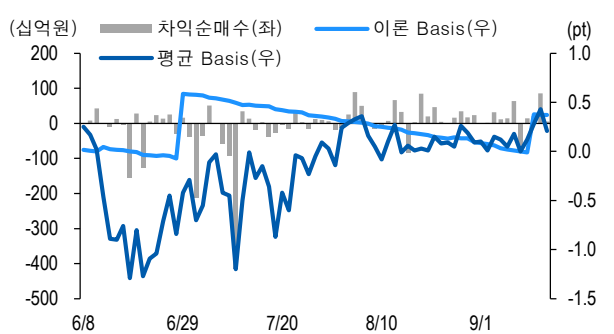
선물옵션시장 지표

2021.9.16

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	412.85	0.12	0.49	9,152.8	-
선물 12월물	413.00	0.10	0.40	27,871.9	253,057
선물 3월물	409.40	0.15	0.60	27.8	7,688
10월물(mini)	412.50	0.11	0.46	1,982.2	43,214
11월물(mini)	413.10	0.19	0.80	3.6	1,728



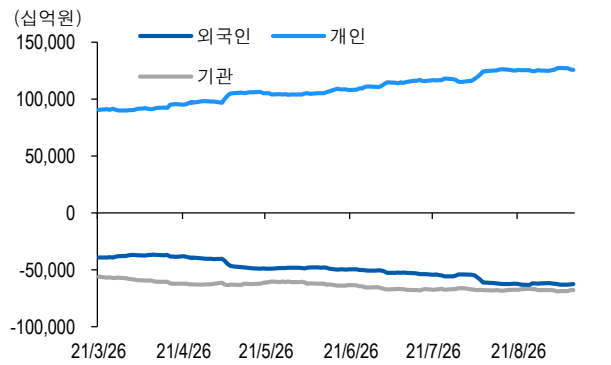
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.37	0.21	0.15	-0.04%
베이스스(mini)	-0.27	-0.34	-0.35	-0.02%
제1스프레드(SP)	-2.95	-3.84	-3.85	-0.21%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.27	-0.36	-0.36	-0.02%



	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	294.2	-16.0	278.2	-1.0	261.1	58.2	63.1	1.9	-1.3	21.0
개인	-183.7	88.2	-95.5	0.0	-3.4	-26.8	-13.9	-1.0	-1.0	4.3
기관	-141.2	-68.6	-209.8	6.5	-6.8	-48.0	-43.2	-0.7	2.6	-26.9
금융투자	-124.1	-96.4	-220.6	4.4	4.2	139.1	-43.3	-0.8	2.9	-21.6
투신	-18.9	-4.5	-23.4	2.1	-23.2	-157.0	0.1	-0.1	-0.1	3.5
은행+보험+기타금융	-28.3	38.2	9.8	0.0	-24.2	-32.5	0.0	0.2	-0.2	1.5
연기금+국가지자체	31.4	-2.1	29.4	0.0	38.9	2.3	0.0	0.0	0.0	-10.2
기타법인	30.7	-3.6	27.1	0.0	0.1	16.7	-6.0	-0.1	-0.3	1.6

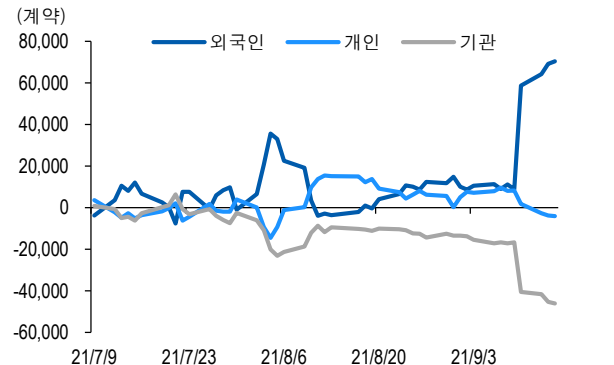
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



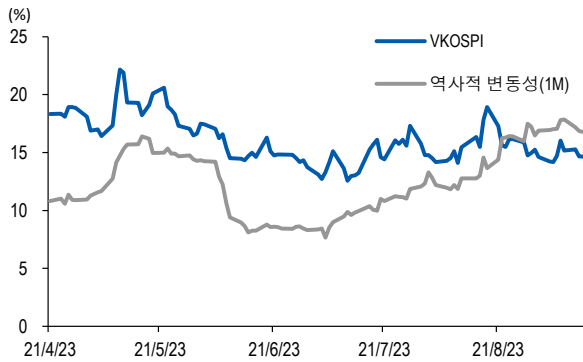
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	571,396	213.3	593,887	12.6%	지수옵션 전체	1,050,773	402.6	1,553,175
Put	479,377	189.4	959,288	14.3%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	14.66%(-0.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	420.0(K+3)	3.01	0.05	37,453	15,116	714	12.6	Put	415.0(K+1)	7.52	-0.47	3,119	3,179	125	13.2
	417.5(K+2)	3.91	0.06	18,298	7,025	424	12.7		412.5(K+0)	6.34	-0.41	6,935	2,916	128	13.6
	415.0(K+1)	5.08	0.15	15,692	5,579	327	13.1		410.0(K-1)	5.32	-0.36	7,676	8,041	355	13.9
	412.5(K+0)	6.33	0.09	5,815	3,832	20	13.3		407.5(K-2)	4.40	-0.37	8,370	4,570	30	14.2
	410.0(K-1)	7.83	0.15	3,213	5,228	-113	13.7		405.0(K-3)	3.65	-0.31	14,051	5,925	705	14.5

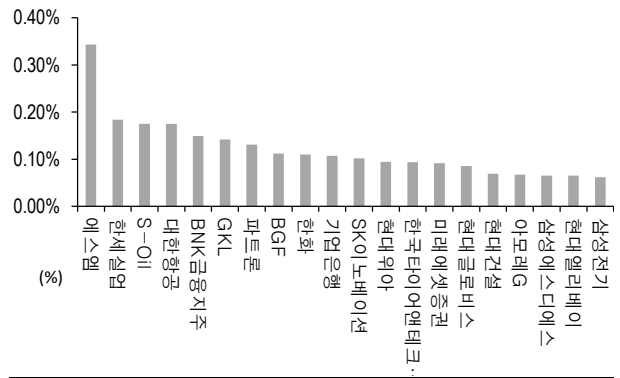
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,426,238	3,036.5	5,576,780	119,340	2,169	48,829	-57,098	21.0	4.3	-26.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	753,000	-0.66	71.4	78.7	31,222	317	0.04%	-193	-22	215	-199	506
삼성전자	76,800	0.39	755.2	78.4	1,122,913	-11,593	0.04%	5,144	6,758	-12,757	-14,308	951
호텔신라	90,100	-0.44	19.7	69.7	25,223	3,603	-0.07%	-597	1,450	-813	2,676	1,411
하나금융지주	45,150	-0.11	30.0	67.9	151,967	5,648	-0.01%	-7,698	340	7,358	78	-4,115
기아	83,400	-0.12	57.2	61.2	51,134	1,973	-0.01%	629	751	-1,380	-999	-370
현대차	209,500	0.00	55.5	56.1	51,235	-3,663	-0.06%	-2,069	-2,651	4,720	1,614	3,106
대한항공	32,650	0.46	50.0	55.6	200,571	23,685	0.18%	-7,220	1,178	6,049	-18,734	-3,328
SK 이노베이션	249,500	-2.54	106.6	55.3	22,457	772	0.10%	100	-870	635	946	-2,735
현대엘리베이	49,100	0.31	3.4	54.6	17,328	827	0.07%	312	547	-859	-390	-469
카카오	123,000	-0.81	614.3	54.4	141,382	1,051	-0.01%	429	-1,586	1,163	3,847	-2,271

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터