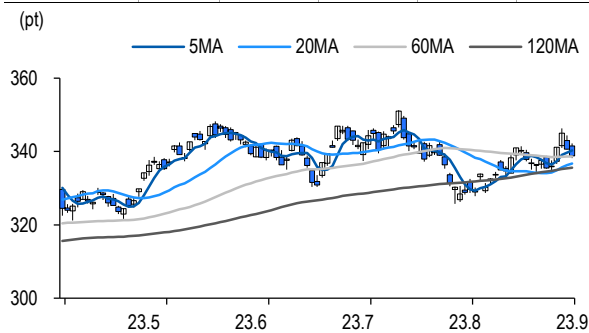
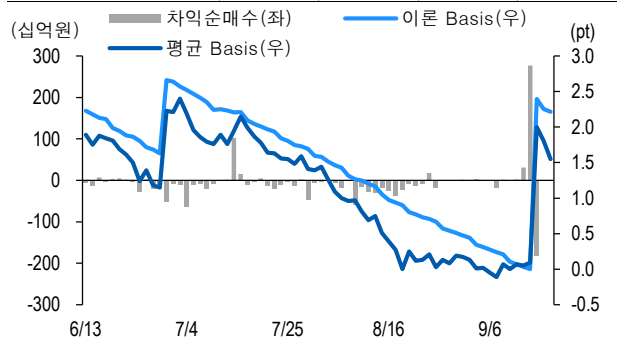


Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	338.82	-0.54	-1.85	5,017.3	-
선물 12월물	340.75	-0.64	-2.20	16,717.3	250,127
선물 3월물	340.25	-0.61	-2.10	20.9	27,062
10월물(mini)	338.84	-0.63	-2.14	1,530.8	91,821
11월물(mini)	339.14	-0.82	-2.80	2.1	5,971



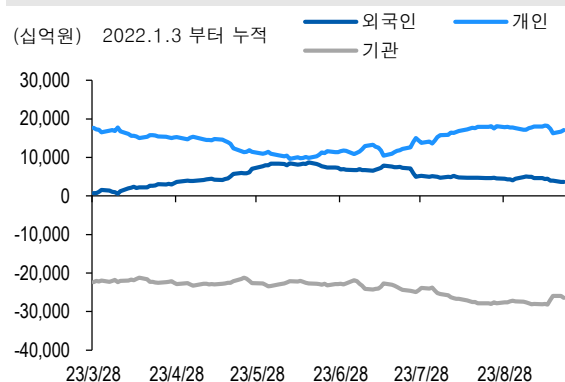
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.21	1.55	1.93	-0.20%
베이스(mini)	-0.00	-0.33	0.02	-0.10%
제1스프레드(SP)	-1.26	-0.65	-0.65	0.18%
합성선물 베이스(ATM)	-0.00	0.03	0.03	0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	2.4	1.0	3.4	0.0	-6.7	-883.0	206.7	-2.1	-1.1	-16.7
개인	360.5	51.5	412.0	0.0	1.4	365.9	-16.1	0.4	0.3	22.7
기관	-384.8	-73.7	-458.4	-1.2	-58.2	489.4	-188.3	1.4	0.7	-6.0
금융투자	-291.9	-72.5	-364.4	-1.2	-3.4	309.6	-184.4	1.5	0.8	2.9
투신	-0.5	-4.8	-5.2	0.0	-38.4	160.7	-3.4	-0.1	0.0	-8.5
은행+보험+기타금융	-2.3	10.0	7.7	0.0	2.5	11.0	-0.5	0.0	0.0	0.7
연기금+국가자재	-29.2	-8.7	-37.9	0.0	-5.8	8.2	0.0	0.0	0.0	-1.2
기타법인	22.0	15.2	37.1	0.0	-1.0	27.6	-2.2	0.2	0.0	0.1

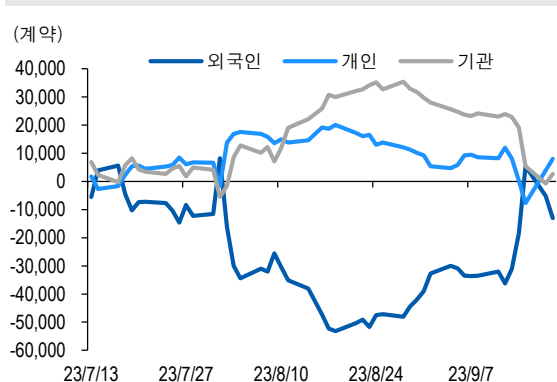
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



# YUANTA

## 선물옵션시장 지표

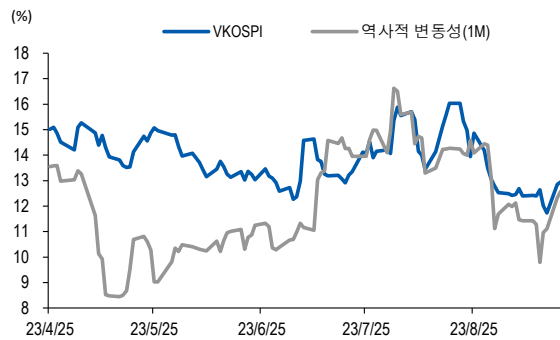
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	505,218	114.0	693,957	11.0%	지수옵션 전체	980,360	252.0	1,810,259			
Put	475,142	138.0	1,116,302	11.7%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	12.95%(+0.10%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	0.98	-0.53	64,498	18,422	3,314	11.0	Put	342.5(K+1)	5.92	1.16	7,664	13,545	455	11.0
	345.0(K+2)	1.52	-0.79	50,389	17,523	1,763	11.0		340.0(K+0)	4.47	0.93	16,278	14,626	213	11.2
	342.5(K+1)	2.33	-1.01	28,862	10,813	1,663	11.2		337.5(K-1)	3.29	0.74	27,246	11,686	440	11.4
	340.0(K+0)	3.32	-1.26	14,371	11,965	1,501	11.2		335.0(K-2)	2.40	0.57	45,596	18,924	-465	11.7
	337.5(K-1)	4.68	-1.38	2,502	3,488	214	11.5		332.5(K-3)	1.65	0.35	49,101	16,582	307	11.8

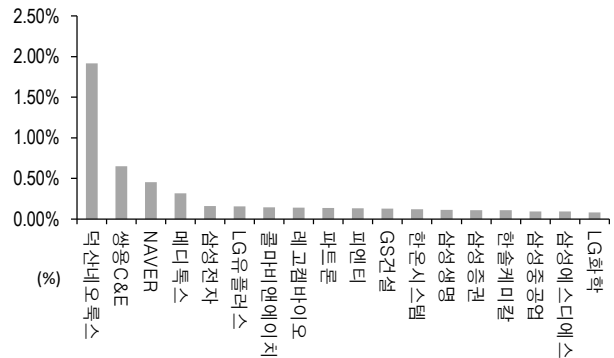
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

### 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	3,439,459	2,470.7	4,800,703	110,372	-32,291	55,810	-25,059	-16.7	22.7	-6.0	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한세실업	20,800	-1.89	4.0	146.6	3,599	803	-0.03%	622	-65	-557	-557	0
삼성전자	69,800	-0.57	673.6	82.2	1,160,098	22,917	0.16%	8,362	18,989	-29,389	-31,689	200
롯데케미칼	146,900	1.59	14.0	81.6	5,367	-27	-0.18%	-38	-139	177	-13	190
DB 하이텍	50,900	-0.97	5.4	78.3	8,034	-58	-0.17%	-1,018	-46	1,064	211	853
SK 하이닉스	119,400	0.34	161.9	72.7	240,141	-9,015	0.00%	-6,695	-2,585	10,029	7,618	2,518
현대제철	39,400	0.90	7.4	72.1	19,164	2,451	0.04%	2,968	48	-3,016	-3,103	87
아모레퍼시픽	126,200	-1.94	11.5	71.8	9,750	124	-0.07%	-36	-45	81	38	43
포스코인터내셔널	79,500	-1.85	70.4	64.8	40,810	1,690	-0.38%	2,850	876	-3,726	-44	-3,682
NAVER	220,500	-1.12	61.4	62.1	51,642	734	0.45%	1,849	37	-1,667	-1,026	-649
삼성전기	142,300	0.21	21.5	61.4	10,043	-601	-0.08%	-1,674	40	1,634	834	800

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터