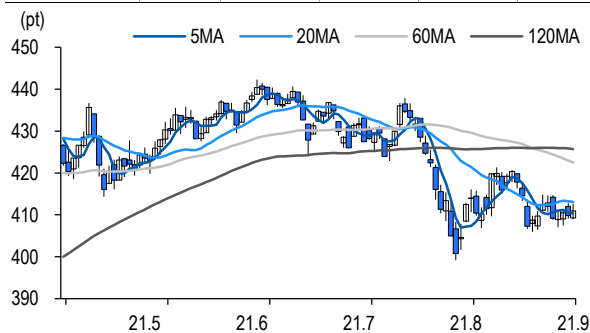


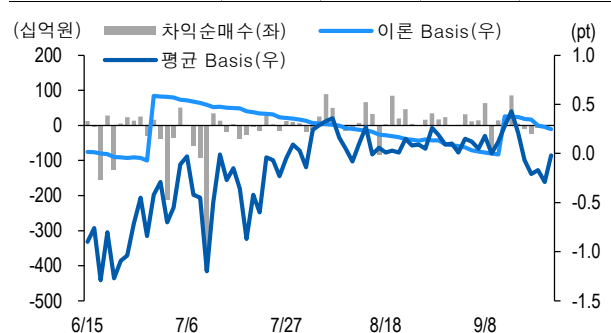
선물옵션시장 지표

2021.9.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	410.97	0.28	1.13	8,177.3	-
선물 12월물	410.70	0.35	1.45	22,501.0	256,818
선물 3월물	406.60	0.21	0.85	18.0	7,399
10월물(mini)	410.32	0.34	1.40	1,798.7	52,762
11월물(mini)	410.48	0.38	1.56	3.6	1,664



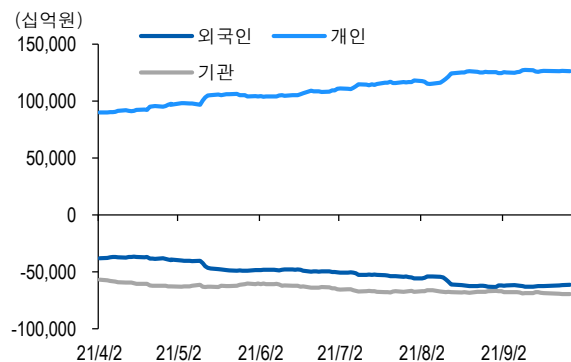
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.25	-0.02	-0.27	-0.06%
베이스(mini)	-0.40	-0.43	-0.65	-0.01%
제1스프레드(SP)	-2.93	-3.90	-3.90	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	-0.40	-0.67	-0.67	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	336.8	-35.7	301.0	0.0	78.6	279.1	-50.0	1.4	1.4	42.1
개인	-339.1	76.9	-262.2	0.0	4.2	-110.5	-21.6	-1.8	-2.0	-6.2
기관	8.5	-53.8	-45.3	1.9	-54.9	-154.4	84.9	0.5	0.9	-35.9
금융투자	97.2	-5.2	92.0	-4.4	6.2	-239.4	84.6	0.5	0.6	-24.5
투신	-16.8	-14.7	-31.4	0.0	-24.6	86.6	0.3	0.0	0.2	1.9
은행+보험+기타금융	-35.7	-38.1	-73.8	0.0	-37.2	4.8	0.0	0.0	0.0	-1.7
연기금+국가지자체	-8.4	0.4	-8.0	6.3	7.8	-6.3	0.0	0.0	0.0	-11.6
기타법인	-6.1	12.6	6.5	0.0	1.7	-14.2	-13.3	-0.2	-0.3	0.0

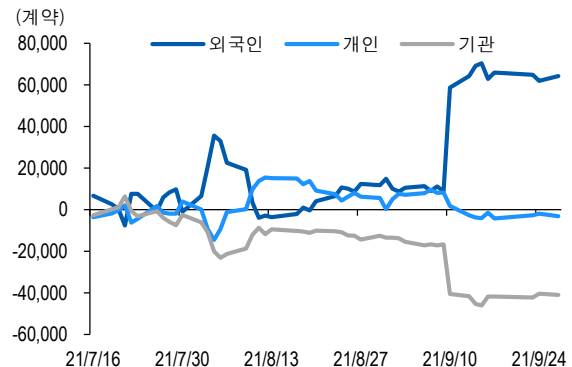
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



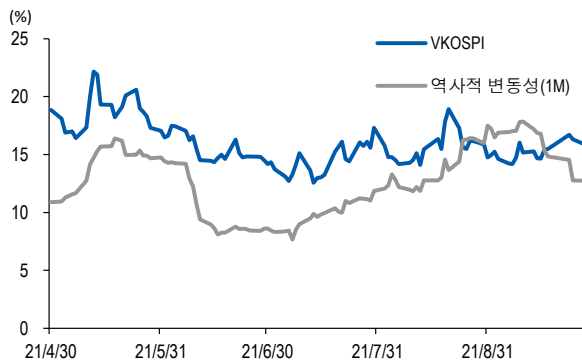
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	617,921	184.0	712,821	12.9%	지수옵션 전체	1,312,408	361.9	1,792,157
Put	694,487	177.8	1,079,336	15.6%	PCR(금액기준)	0.97	VKOSPI	15.92%(-0.41%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	417.5(K+3)	2.07	0.00	57,716	11,240	454	12.9	Put	412.5(K+1)	6.19	-1.28	4,056	3,733	205	14.2
	415.0(K+2)	2.92	0.03	37,256	10,055	1,458	13.2		410.0(K+0)	4.99	-1.21	8,789	10,127	640	14.5
	412.5(K+1)	3.97	0.10	16,962	6,422	710	13.4		407.5(K-1)	3.99	-1.13	9,184	7,794	438	14.9
	410.0(K+0)	5.29	0.21	7,892	8,867	425	13.7		405.0(K-2)	3.18	-1.02	20,421	7,669	1,369	15.3
	407.5(K-1)	6.77	0.25	2,747	4,505	84	14.0		402.5(K-3)	2.51	-0.94	31,174	6,590	682	15.7

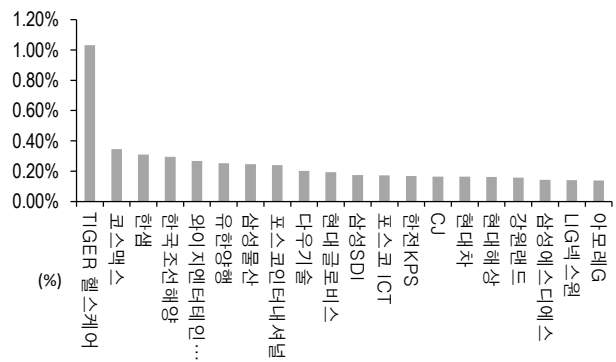
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,988,715	2,391.6	5,771,094	15,202	102,299	-29,889	-72,170	42.1	-6.2	-35.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	257,000	0.00	20.3	84.1	6,384	181	0.03%	620	-57	-563	-48	-515
현대제철	48,800	0.21	20.8	78.0	20,095	688	0.04%	3,479	-906	-2,573	-4,531	1,245
삼성 SDI	737,000	1.66	159.6	74.2	39,170	1,303	0.17%	596	518	-1,124	-1,437	-240
GS 건설	44,250	-0.34	15.2	73.3	51,788	1,769	0.05%	389	1,015	-1,404	-2,009	-950
하나금융지주	44,650	-0.67	19.7	67.0	149,613	-12	0.03%	-1,541	1,317	224	1,626	-1,223
LG 디스플레이	19,350	2.65	26.7	63.1	374,656	-5,633	-0.16%	33,491	-14,276	-19,215	-4,436	-13,459
카카오	121,000	1.26	263.0	59.9	146,986	-5,409	0.13%	-5,514	11,240	-5,692	-6,755	-2,000
삼성전자	77,200	0.26	504.8	56.0	1,116,364	-12,436	0.07%	33,597	-13,052	-20,560	-19,901	2,350
NAVER	403,500	-0.62	98.5	53.6	60,850	-1,465	0.04%	-2,221	936	1,285	-232	1,517
SK 하이닉스	105,000	0.96	95.5	50.7	133,092	1,397	-0.03%	841	-419	-422	-96	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터