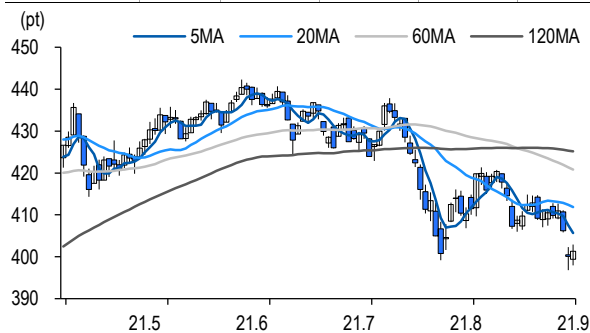


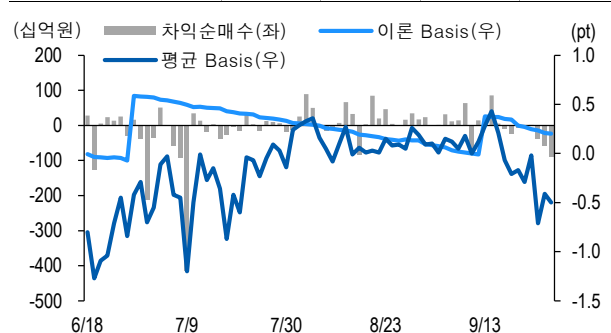
선물옵션시장 지표

2021.10.1

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	401.30	0.30	1.21	10,207.4	-
선물 12월물	401.50	0.59	2.35	31,207.4	272,664
선물 3월물	397.20	0.52	2.05	28.0	7,490
10월물(mini)	401.34	0.56	2.24	2,910.4	68,964
11월물(mini)	401.40	0.50	1.98	3.6	5,372



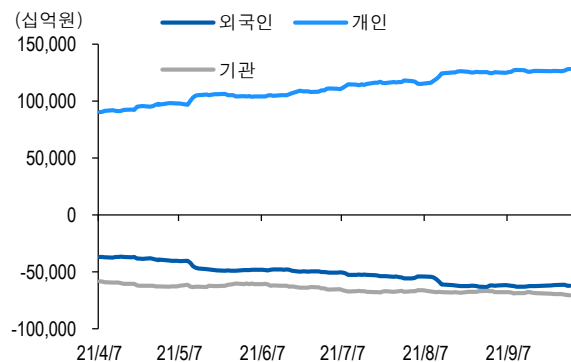
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.20	-0.50	0.20	-0.17%
베이스(mini)	-0.44	-0.67	0.04	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.93	-3.88	-3.95	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	-0.44	0.00	0.00	0.11%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	34.6	23.8	58.4	-0.9	-117.7	88.5	-219.8	1.6	0.6	-60.9
개인	167.9	15.2	183.1	0.0	-5.2	-236.3	-92.2	-1.1	-0.7	8.4
기관	-223.4	-38.6	-262.1	-89.2	-6.0	165.5	319.2	-0.5	0.4	53.3
금융투자	-226.0	-120.0	-345.9	-99.4	-38.2	-303.0	315.6	-0.5	-0.2	25.3
투신	28.1	4.2	32.3	0.0	20.6	474.9	3.5	0.0	0.6	10.2
은행+보험+기타금융	0.5	59.8	60.3	0.0	15.7	9.1	0.1	0.0	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-60.6	-0.7	-61.2	10.1	15.5	-15.5	0.0	0.0	0.0	17.4
기타법인	21.0	-0.4	20.6	0.0	2.2	-17.8	-7.2	0.0	-0.3	-0.7

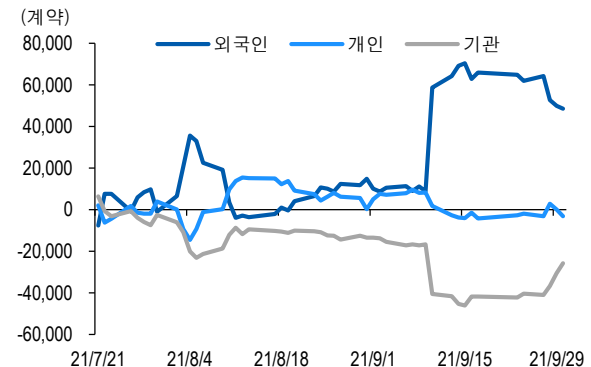
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



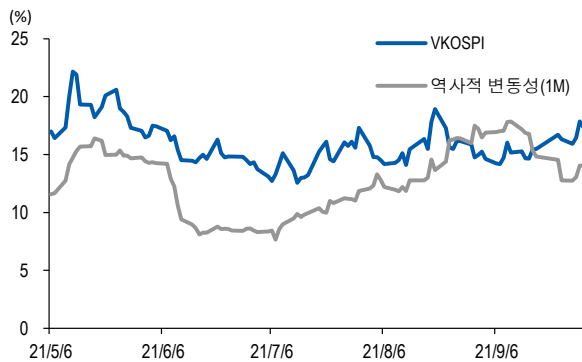
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)						
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정		
Call	909,523		292.6		824,341		14.0%		지수옵션 전체		1,849,228		580.9		1,968,494	
Put	939,705		288.3		1,144,153		17.0%		PCR(금액기준)		0.99		VKOSPI		17.35%(−0.52%p)	

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	407.5(K+3)	2.15	0.27	78,505	14,697	3,344	13.9	Put	402.5(K+1)	5.47	−1.62	3,333	6,562	−10	15.2
	405.0(K+2)	3.10	0.40	80,591	10,820	2,395	14.3		400.0(K+0)	4.37	−1.46	18,078	22,954	−45	15.7
	402.5(K+1)	4.27	0.59	40,591	5,567	1,365	14.7		397.5(K−1)	3.46	−1.31	15,452	12,150	−216	16.1
	400.0(K+0)	5.67	0.76	22,861	4,891	488	15.1		395.0(K−2)	2.73	−1.14	38,736	16,525	471	16.6
	397.5(K−1)	7.27	0.94	5,510	2,156	−324	15.6		392.5(K−3)	2.14	−0.98	36,151	14,147	905	17.1

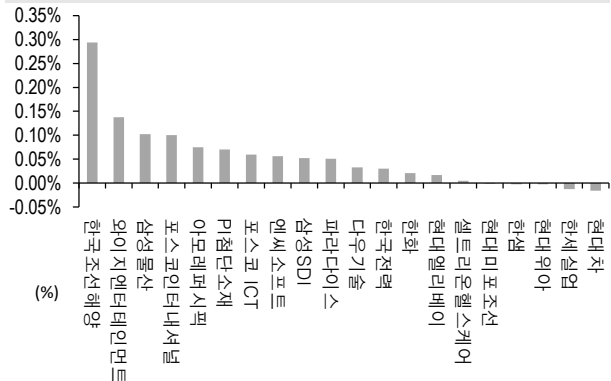
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)											(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,943,786	3,429.8	5,833,918	35,474	-45,857	17,442	27,765	-60.9	8.4	53.3		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균피리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	42,850	1.06	10.7	70.5	52,139	-656	-0.04%	-795	-112	902	1,203	-301
삼성전자	74,300	0.13	943.1	69.8	1,120,191	17,424	-0.12%	-33,162	30,407	2,515	-8,913	11,772
SK 하이닉스	103,500	3.50	271.1	68.3	128,983	-14,387	-0.15%	2,524	-14,213	11,744	1,476	1,600
삼성 SDI	718,000	1.41	110.3	61.0	41,393	94	0.05%	-502	140	362	-640	1,009
LG 화학	778,000	1.04	155.4	59.8	13,538	-321	-0.12%	-233	-402	635	-415	717
카카오	118,500	1.72	324.2	59.1	148,813	-15	-0.12%	2,057	588	-2,635	-2,794	-149
POSCO	331,000	0.30	52.5	56.8	24,197	66	-0.06%	543	185	-851	-789	-60
현대제철	47,350	0.42	13.4	56.1	18,820	-147	-0.07%	-518	566	-48	1,381	-1,205
대한항공	33,650	0.30	47.0	54.5	222,923	-14,014	-0.06%	-9,992	3,437	6,320	15,343	183
KT	32,600	0.93	12.2	51.5	69,960	2,991	-0.07%	-3,267	3,087	182	-136	318

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터