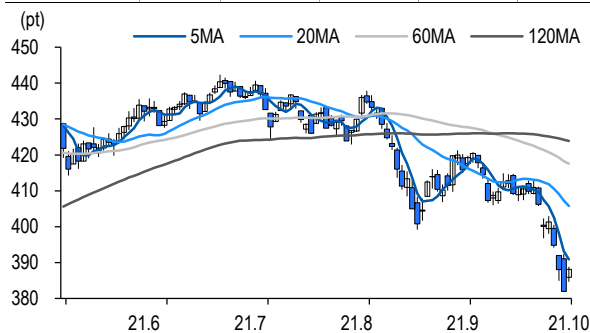


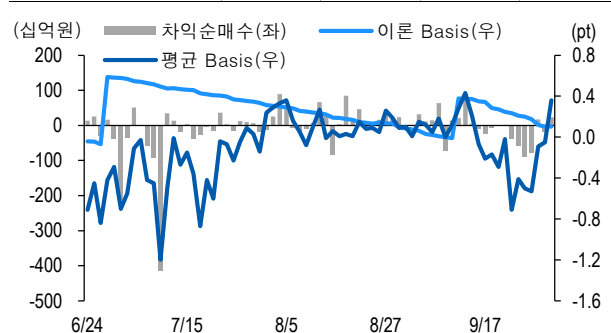
선물옵션시장 지표

2021.10.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	388.14	1.63	6.21	8,882.2	-
선물 12월물	388.20	1.52	5.80	37,025.1	274,954
선물 3월물	384.15	1.57	5.95	51.8	9,360
10월물(mini)	387.94	1.54	5.90	2,738.7	96,232
11월물(mini)	388.10	1.51	5.76	16.0	6,189



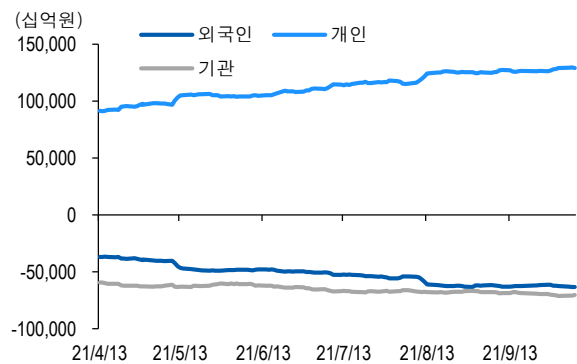
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.10	0.36	0.06	0.07%
베이스(mini)	-0.52	-0.03	-0.20	0.13%
제1스프레드(SP)	-2.97	-4.02	-4.05	-0.27%
합성선물 베이스(ATM)	-0.52	-0.15	-0.15	0.10%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-106.1	25.7	-80.3	0.0	240.7	-64.5	-44.6	-4.4	14.3	99.3
개인	-532.6	-9.6	-542.2	0.0	2.3	276.9	-23.9	1.4	-11.0	-6.7
기관	614.3	-5.0	609.3	23.3	-64.1	-179.7	76.9	3.1	-3.3	-96.4
금융투자	582.3	-135.6	446.7	11.9	16.2	-646.0	76.8	3.1	-2.4	-105.2
투신	61.5	29.6	91.1	1.9	31.9	481.7	0.1	0.0	0.1	59.4
은행+보험+기타금융	-6.2	117.5	111.3	0.0	-4.1	-6.7	0.1	0.0	-0.9	0.0
연기금+국가지자체	-19.9	-9.5	-29.4	7.5	-116.9	-8.6	0.0	0.0	0.0	-50.6
기타법인	24.4	-11.1	13.2	0.0	0.6	-32.7	-8.5	-0.1	-0.1	3.8

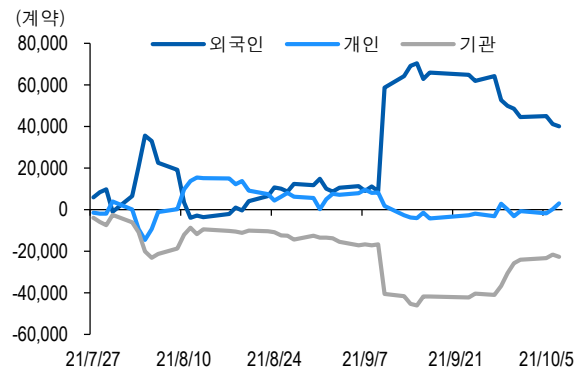
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



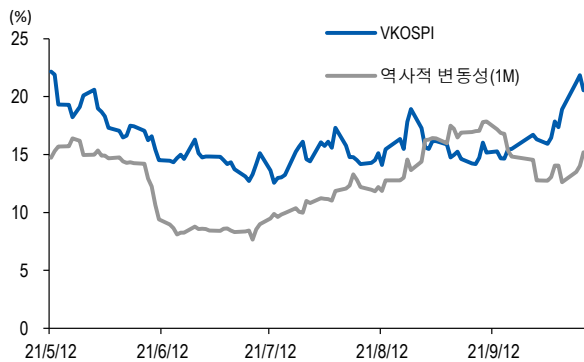
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,358,577	415.1	1,058,596	17.2%	지수옵션 전체	2,681,935	817.0	2,353,360
Put	1,323,358	401.9	1,294,764	21.2%	PCR(금액기준)	0.97	VKOSPI	20.54%(-1.30%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	390.0(K+3)	3.16	1.40	142,312	12,130	3,905	17.3	Put	385.0(K+1)	3.03	-3.42	43,823	18,413	-1,587	19.5
	387.5(K+2)	4.47	1.91	49,494	6,787	1,920	17.9		382.5(K+0)	2.31	-2.89	47,939	12,993	820	20.3
	385.0(K+1)	6.03	2.43	15,308	5,430	1,694	18.5		380.0(K-1)	1.71	-2.46	103,966	31,064	816	20.8
	382.5(K+0)	7.80	2.96	3,713	2,115	1,295	19.1		377.5(K-2)	1.28	-2.06	131,865	18,254	331	21.6
	380.0(K-1)	9.71	3.42	1,288	1,358	688	19.6		375.0(K-3)	0.94	-1.69	121,957	36,227	501	22.2

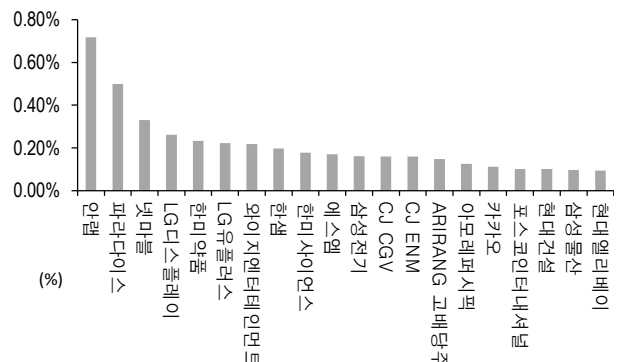
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,326,866	3,585.0	5,807,771	-8,089	195,400	-62,746	-137,869	99.3	-6.7	-96.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	41,850	3.72	23.6	118.3	40,883	-7,160	-0.02%	1,651	-3,225	1,574	2,484	1,778
현대건설	50,700	3.79	17.6	91.9	15,233	-1,065	0.10%	2,494	-997	-1,633	-10,213	0
한국조선해양	97,000	2.54	18.8	89.8	16,102	-1,690	0.00%	32	1,223	-1,585	-1,263	-322
LG 화학	734,000	-1.61	139.1	75.8	12,631	-212	-0.06%	1,815	-948	-867	-736	-153
삼성전기	165,500	3.44	53.2	73.7	20,040	-4,184	0.16%	469	8,128	-8,594	-4,283	-4,258
삼성 SDI	668,000	-0.30	112.4	69.8	31,403	-959	-0.05%	431	333	-802	329	-54
현대제철	44,650	3.12	20.1	69.5	20,232	1,058	0.03%	2,552	-2,001	-584	-978	393
하나금융지주	45,400	1.34	18.5	69.4	102,252	-13,835	-0.01%	1,151	-967	-184	-2,867	2,683
삼성생명	72,800	0.00	10.1	69.1	16,969	-560	0.01%	-2,444	392	2,008	935	1,073
삼성전자	71,700	0.70	655.6	67.6	979,079	-26,927	-0.01%	25,957	-4,951	-20,972	9,410	-31,359

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터