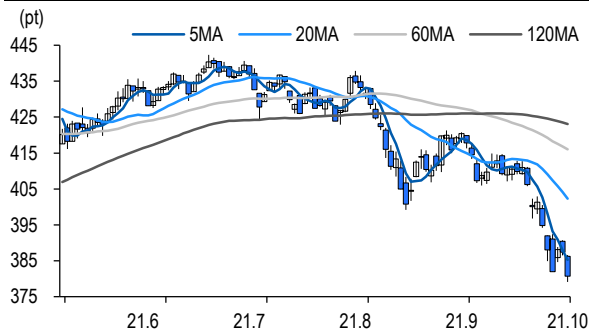


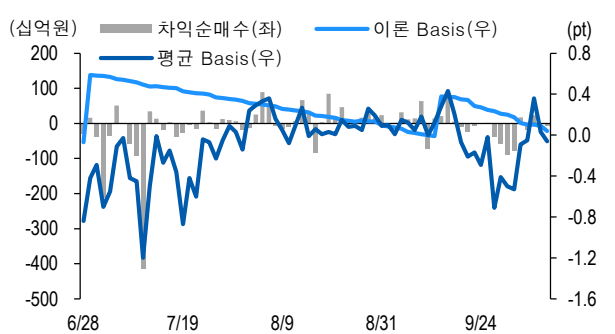
선물옵션시장 지표

2021.10.13

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	380.69	-1.74	-6.73	9,445.3	-
선물 12월물	380.25	-2.01	-7.80	36,422.0	278,662
선물 3월물	376.55	-1.95	-7.50	16.4	10,265
10월물(mini)	380.04	-1.99	-7.70	2,738.3	114,434
11월물(mini)	379.62	-2.10	-8.16	34.8	7,956

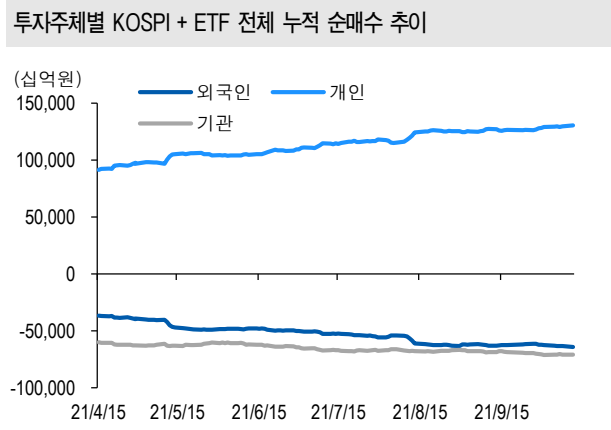


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.04	-0.06	-0.44	-0.03%
베이스스(mini)	-0.58	-0.28	-0.65	0.08%
제1스프레드(SP)	-2.98	-3.95	-3.75	-0.25%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.58	-0.67	-0.67	-0.02%

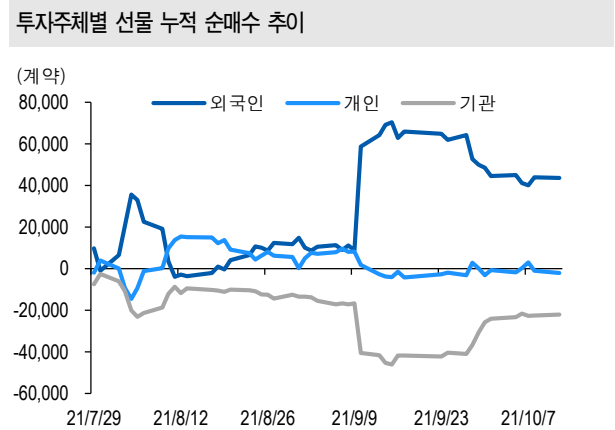


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-821.0	-27.6	-848.6	-16.4	-469.6	60.5	-95.9	4.9	-13.9	15.1
개인	979.4	27.0	1,006.4	0.0	-3.4	-129.6	28.6	-5.2	21.0	-79.5
기관	-199.8	-1.7	-201.5	8.3	57.5	-22.5	66.0	1.5	-8.9	65.7
금융투자	-206.1	-113.7	-319.7	-0.3	0.3	198.2	66.1	3.5	-8.9	49.1
투신	4.8	6.3	11.1	-3.6	3.7	-176.3	-0.1	-0.3	0.2	5.0
은행+보험+기타금융	-43.9	108.8	65.0	0.5	-33.8	-39.8	-0.1	-1.7	-0.2	0.1
연기금+국가자재	48.7	-6.4	42.3	11.7	88.5	-4.5	0.0	0.0	0.0	11.5
기타법인	41.4	2.3	43.7	0.0	-1.0	91.6	1.4	-1.1	1.8	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

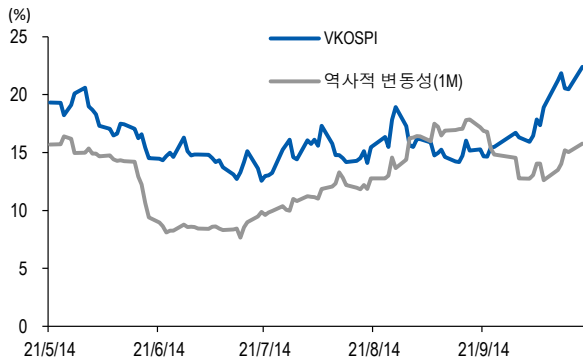
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,963,565	319.2	1,205,374	18.4%	지수옵션 전체	4,285,709	980.5	2,640,977
Put	2,322,144	661.3	1,435,603	23.7%	PCR(금액기준)	2.07	VKOSPI	22.40%(+1.93%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	395.0(K+3)	0.04	-0.79	203,565	28,590	6,843	19.1	Put	390.0(K+1)	10.15	5.38	7,110	22,055	-1,276	27.7
	392.5(K+2)	0.09	-1.45	256,171	29,204	9,451	18.5		387.5(K+0)	7.89	4.32	13,353	11,958	-2,512	25.3
	390.0(K+1)	0.20	-2.30	374,417	30,866	16,893	18.1		385.0(K-1)	5.83	3.21	33,334	19,711	-345	23.5
	387.5(K+0)	0.41	-3.44	305,909	20,812	13,227	17.5		382.5(K-2)	4.15	2.22	57,622	13,630	-841	23.1
	385.0(K-1)	0.96	-4.46	221,001	15,337	9,840	18.4		380.0(K-3)	2.85	1.46	161,483	26,315	-5,741	23.3

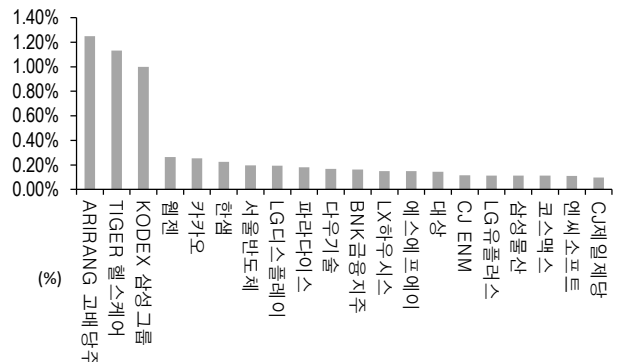
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,575,147	4,023.6	5,897,248	67,498	53,412	-88,958	36,116	15.1	-79.5	65.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	123,500	2.92	188.0	86.1	56,459	-9,738	-0.12%	4,841	3,577	-8,249	-11,759	-504
GS 건설	40,900	-0.24	13.1	79.5	34,193	-3,539	0.05%	5,174	-2,543	-2,581	-2,140	-441
카카오	114,000	-2.15	294.1	67.7	142,776	940	0.25%	4,874	833	-5,710	-8,365	-3,400
현대제철	45,600	0.00	16.8	66.9	19,079	-190	-0.02%	-88	-182	270	689	-419
SK 이노베이션	257,000	3.01	79.2	62.7	15,365	-1,195	-0.03%	942	956	-1,821	-1,498	158
기아	82,200	0.37	76.5	62.2	43,662	-5,437	-0.03%	-2,241	-1,925	4,166	954	2,992
현대차	204,000	-0.49	98.9	59.3	43,628	-8,061	0.08%	751	-2,418	1,676	6	-1,050
POSCO	321,000	0.00	57.3	55.0	22,739	-679	0.02%	400	-238	-206	529	-732
삼성 SDI	665,000	-3.06	133.1	53.3	18,879	-11,041	0.00%	-952	33	977	1,021	-44
하나금융지주	44,200	-1.12	27.1	51.6	75,063	-10,949	0.00%	3,925	2,004	-6,964	-8,881	1,920

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터