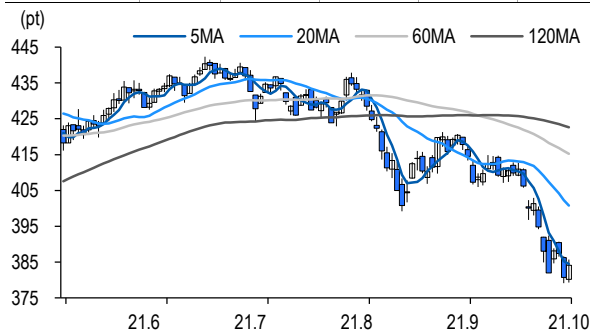


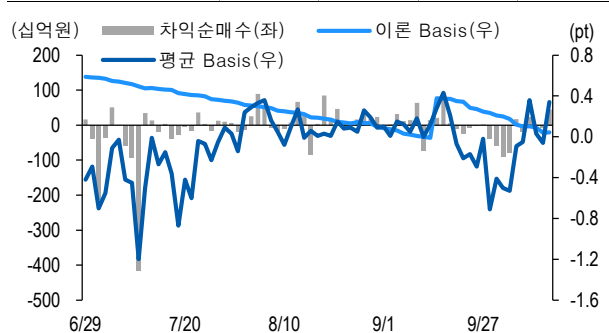
선물옵션시장 지표

2021.10.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	384.10	0.90	3.41	8,380.2	-
선물 12월물	384.60	1.14	4.35	26,566.4	279,523
선물 3월물	380.80	1.13	4.25	30.5	10,698
10월물(mini)	384.34	1.13	4.30	2,063.8	113,819
11월물(mini)	384.56	1.30	4.94	64.5	19,843



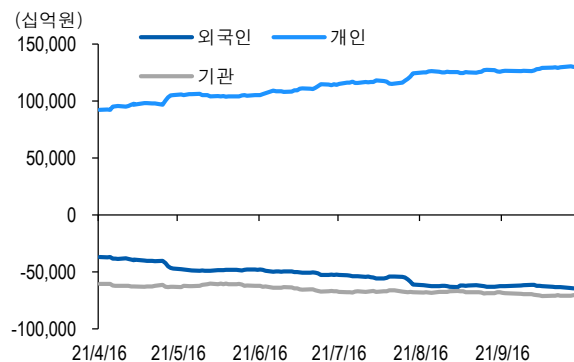
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.04	0.34	0.50	0.08%
베이스(mini)	-0.59	0.00	0.24	0.15%
제1스프레드(SP)	-2.97	-3.75	-3.75	-0.20%
합성선물 베이스(ATM)	-0.59	0.18	0.18	0.20%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-273.0	39.2	-233.8	3.2	-65.6	582.1	15.0	3.2	3.4	42.4
개인	-531.3	22.2	-509.0	0.0	-4.1	-74.2	-39.1	-0.5	-1.0	-103.8
기관	772.4	-62.4	710.0	41.1	118.0	-432.6	29.5	-0.4	-0.6	60.9
금융투자	588.3	-37.5	550.9	14.5	30.9	-752.6	29.3	2.0	0.0	82.7
투신	82.5	20.5	103.0	9.6	48.8	248.2	0.0	-1.2	-0.1	14.3
은행+보험+기타금융	-4.1	-39.0	-43.2	0.0	-0.9	80.1	0.1	-1.2	-0.5	0.0
연기금+국가지자체	78.6	0.3	78.9	7.5	-2.3	-8.2	0.0	0.0	0.0	-36.1
기타법인	31.9	0.9	32.8	0.0	0.3	-75.3	-5.3	-2.2	-1.8	0.5

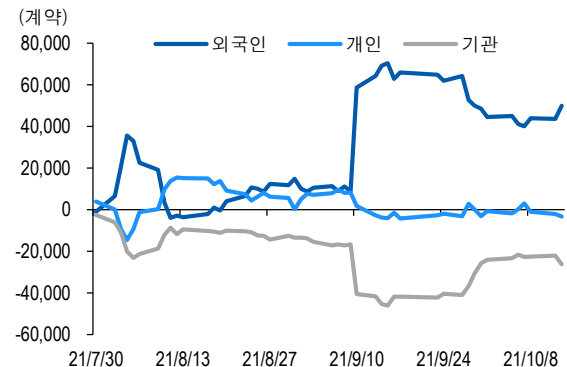
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



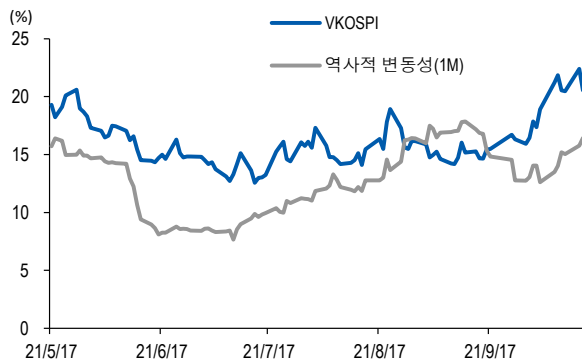
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,975,724	392.9	1,242,303	15.9%	지수옵션 전체	4,110,225	731.9	2,718,984
Put	2,134,501	339.1	1,476,681	19.2%	PCR(금액기준)	0.86	VKOSPI	20.54%(-1.86%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	387.5(K+3)	0.58	0.17	472,608	22,861	2,049	15.6	Put	382.5(K+1)	1.22	-2.93	164,224	19,668	6,038	17.0
	385.0(K+2)	1.50	0.54	273,681	17,089	1,752	16.8		380.0(K+0)	0.57	-2.28	281,628	37,004	10,689	17.6
	382.5(K+1)	2.99	1.19	97,485	8,136	593	18.4		377.5(K-1)	0.28	-1.63	335,676	24,907	6,273	19.0
	380.0(K+0)	4.85	1.85	30,542	5,694	-1,359	19.5		375.0(K-2)	0.12	-1.21	294,555	43,373	1,907	19.9
	377.5(K-1)	7.05	2.45	3,917	1,111	-170	21.6		372.5(K-3)	0.06	-0.74	224,599	41,022	2,843	21.4

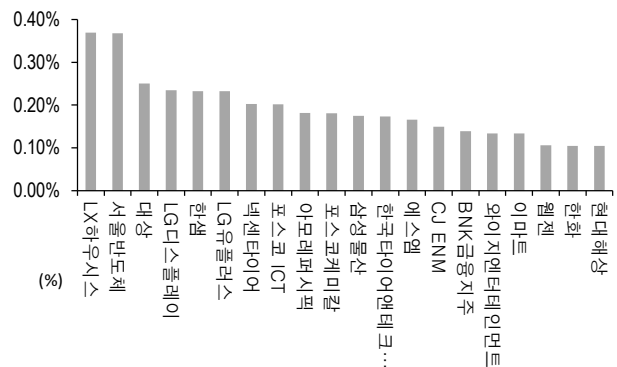
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,978,327	3,940.0	5,948,180	50,932	63,493	-85,844	21,968	42.4	-103.8	60.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	41,650	1.83	12.4	86.4	25,396	-8,797	0.04%	283	-1,067	784	1,107	-323
SK 이노베이션	259,000	0.78	54.4	68.3	13,564	-1,801	-0.07%	-2,108	-186	2,284	402	1,882
카카오	117,500	3.07	211.6	67.0	111,048	-31,728	0.09%	793	-3,589	2,764	781	456
하나금융지주	44,150	-0.11	21.1	66.7	47,682	-27,381	-0.03%	702	-994	348	-841	1,189
NAVER	380,000	2.15	143.9	65.8	29,735	-6,686	-0.29%	2,706	-16,179	13,548	13,375	179
삼성전자	69,200	0.14	950.5	57.4	603,254	-188,940	-0.03%	21,827	7,252	-28,126	21,520	-50,100
현대제철	47,300	3.73	24.0	55.3	15,495	-3,584	0.00%	-819	-3,807	4,626	3,891	735
LG 전자	122,000	-1.21	62.5	55.1	49,782	-6,677	0.08%	-4,568	-2,251	6,613	1,097	790
SK 하이닉스	92,100	0.77	142.7	51.3	73,800	-21,287	-0.04%	-2,477	-3,088	5,589	8,787	664
삼성 SDI	675,000	1.50	67.7	48.5	9,948	-8,931	0.07%	3	-383	384	119	80

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터