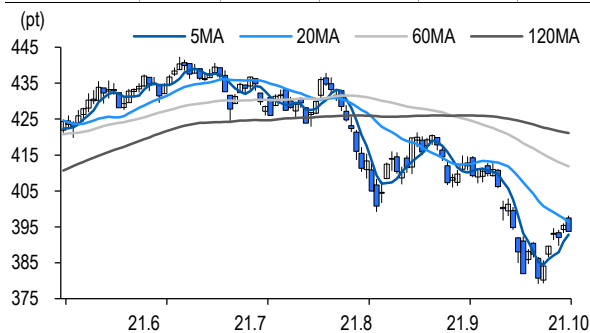


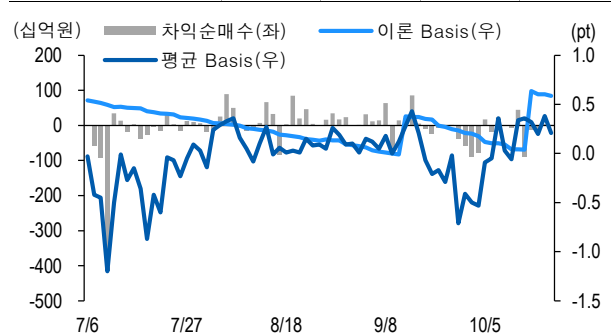
선물옵션시장 지표

2021.10.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.74	-0.42	-1.67	7,492.4	-
선물 12월물	394.00	-0.45	-1.80	20,996.6	266,435
선물 3월물	390.05	-0.45	-1.75	10.5	11,346
11월물(mini)	393.70	-0.48	-1.90	1,541.8	42,365
12월물(mini)	393.98	-0.46	-1.92	6.0	4,190



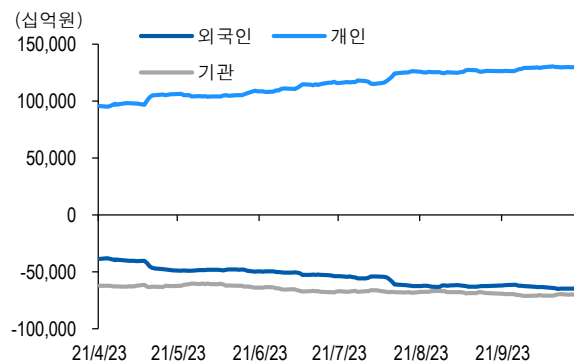
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.59	0.21	0.26	-0.10%
베이스(mini)	0.26	0.00	-0.04	-0.07%
제1스프레드(SP)	-2.91	-3.80	-3.80	-0.23%
합성선물 베이스(ATM)	0.26	0.00	0.00	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-72.9	0.5	-72.4	-1.7	-128.4	-45.4	-16.5	-0.7	1.7	-27.6
개인	284.2	43.3	327.5	0.0	-4.5	131.8	41.3	-0.3	-2.3	-14.7
기관	-208.3	-57.6	-265.9	3.7	-4.1	-77.9	-27.0	1.0	0.7	36.1
금융투자	17.8	-7.3	10.4	-0.3	57.2	184.0	-26.1	1.0	0.7	8.5
투신	-54.0	5.5	-48.6	0.0	-4.8	-238.2	-0.8	-0.1	0.0	1.1
은행+보험+기타금융	-29.7	-49.3	-79.1	0.0	-5.2	-8.6	0.0	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	-101.4	-6.2	-107.6	3.9	-44.6	-15.1	0.0	0.0	0.0	26.6
기타법인	-2.9	13.7	10.8	0.0	-0.1	-8.5	2.2	0.0	-0.1	6.3

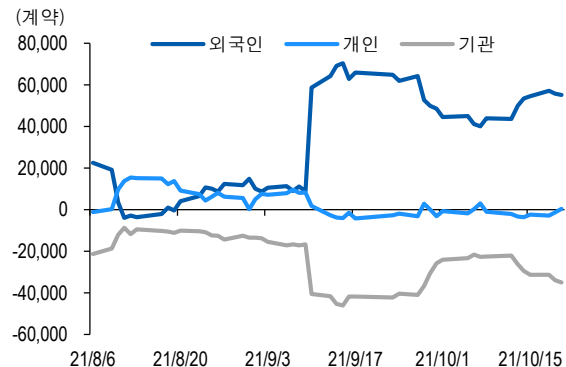
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



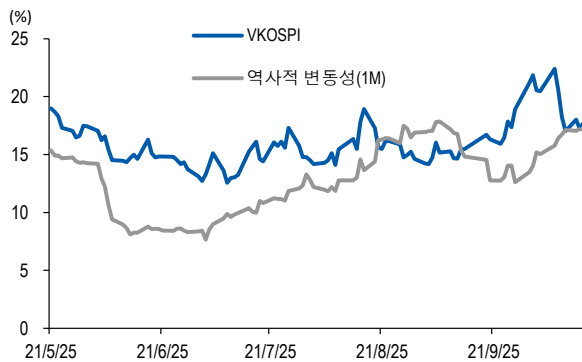
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	406,389	143.2	646,408	14.4%	지수옵션 전체	989,346	336.2	1,667,180
Put	582,957	193.0	1,020,772	17.1%	PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI	17.73%(+0.49%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	2.46	-0.63	20,606	7,641	818	14.4	Put	397.5(K+1)	8.15	0.99	3,177	990	313	15.8
	400.0(K+2)	3.32	-0.73	19,209	13,277	1,504	14.7		395.0(K+0)	6.85	0.86	7,825	4,641	1,130	16.1
	397.5(K+1)	4.37	-0.84	6,139	4,962	282	15.0		392.5(K-1)	5.75	0.75	5,772	3,534	293	16.5
	395.0(K+0)	5.59	-0.93	4,699	7,047	190	15.4		390.0(K-2)	4.79	0.64	15,978	9,996	552	16.8
	392.5(K-1)	6.96	-1.07	1,820	4,397	38	15.7		387.5(K-3)	4.02	0.58	18,595	5,146	910	17.3

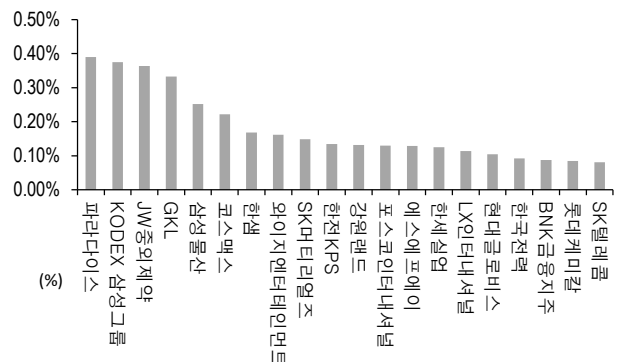
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,006,979	2,501.5	4,938,236	63,384	10,326	-21,704	5,268	-27.6	-14.7	36.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	209,000	-0.48	71.3	73.1	47,217	-4,217	0.02%	-190	-2,650	2,840	1,301	1,539
NAVER	408,000	0.00	169.9	69.8	62,877	5,586	0.03%	-522	4,405	-4,120	-4,592	1,041
삼성전자	70,400	-0.42	496.1	69.5	1,040,113	-32,041	-0.06%	-5,963	-764	2,211	8,628	1,302
LG 화학	837,000	0.97	149.2	64.2	9,548	-87	-0.10%	-809	-500	1,310	238	176
기아	84,000	-0.59	70.5	62.9	49,877	-1,014	-0.02%	-1,102	-9	1,191	-476	1,612
현대모비스	268,500	-1.10	27.6	59.6	9,605	-891	-0.06%	-392	1,250	-858	-171	47
삼성 SDI	729,000	0.14	84.1	59.4	30,387	470	0.01%	-451	722	-256	57	-313
현대엘리베이	48,850	1.14	4.7	58.5	21,032	649	0.07%	826	-213	-613	-360	-262
SK 하이닉스	98,100	0.41	110.6	56.8	94,227	-1,336	-0.10%	-5,292	-2,163	7,455	3,923	3,177
GS 건설	41,200	-1.20	8.1	55.1	50,055	-1,238	0.02%	723	-1,412	689	-1,223	1,912

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터