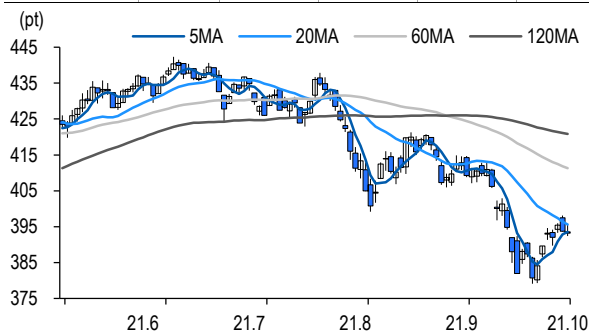


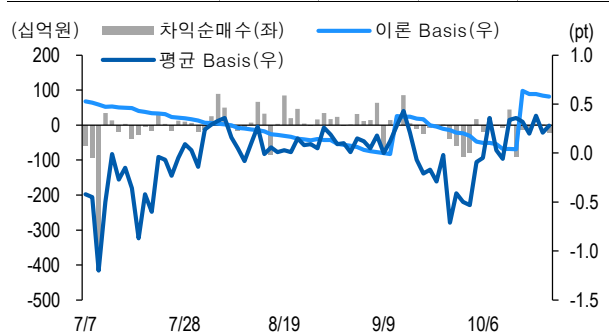
## 선물옵션시장 지표

2021.10.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.18	-0.14	-0.56	7,002.9	-
선물 12월물	393.40	-0.15	-0.60	22,566.8	269,313
선물 3월물	389.65	-0.10	-0.40	9.7	11,076
11월물(mini)	393.14	-0.14	-0.56	1,605.2	44,602
12월물(mini)	393.60	-0.10	-0.38	4.5	4,275



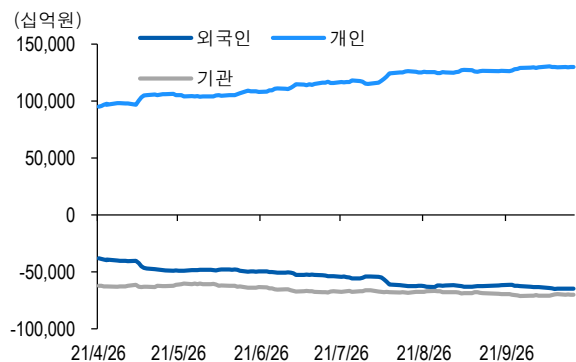
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.58	0.28	0.22	-0.08%
베이스(mini)	0.25	0.04	-0.04	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.91	-3.84	-3.85	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	0.00	0.00	-0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	42.9	-53.3	-10.4	-19.5	138.6	276.4	-17.2	0.0	0.0	15.7
개인	-160.5	87.5	-73.0	0.0	-1.3	-110.1	1.2	0.0	0.6	-12.0
기관	127.9	-37.9	90.1	-3.8	24.8	-164.8	15.0	0.0	-0.4	-4.5
금융투자	188.8	-124.8	64.0	0.0	35.9	-98.7	15.1	0.2	-0.3	4.0
투신	-8.9	2.5	-6.4	0.0	0.3	-76.2	-0.1	-0.1	0.0	-6.0
은행+보험+기타금융	-16.3	82.3	66.0	0.0	-10.7	-4.6	0.0	0.0	-0.1	0.0
연기금+국가지자체	-41.5	-0.4	-41.9	-3.8	-2.2	14.7	0.0	0.0	0.0	-2.5
기타법인	-10.3	3.6	-6.7	0.0	-0.2	-1.5	1.0	0.0	-0.2	0.8

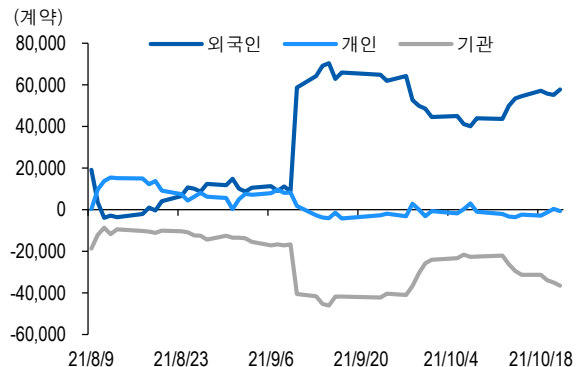
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

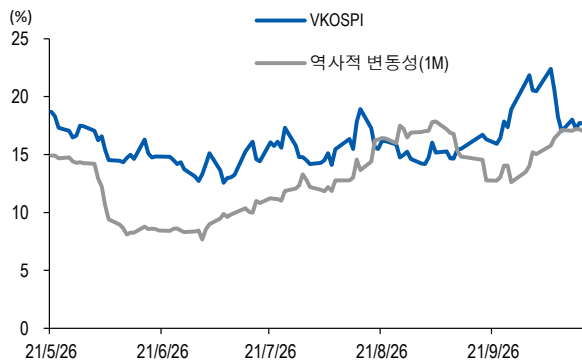
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	466,638	158.1	657,585	14.3%	지수옵션 전체	976,591	347.4	1,699,215
Put	509,953	189.3	1,041,630	17.3%	PCR(금액기준)	1.20	VKOSPI	17.68%(-0.05%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	2.88	-0.44	29,519	14,202	925	14.3	Put	395.0(K+1)	6.86	0.01	5,167	5,013	372	15.7
	397.5(K+2)	3.87	-0.50	11,389	6,095	1,133	14.6		392.5(K+0)	5.72	-0.03	6,259	4,353	819	16.1
	395.0(K+1)	5.04	-0.55	7,933	7,849	802	15.0		390.0(K-1)	4.78	-0.01	10,850	10,320	324	16.6
	392.5(K+0)	6.40	-0.56	2,967	4,578	181	15.4		387.5(K-2)	3.97	-0.05	13,637	4,942	-204	17.0
	390.0(K-1)	7.92	-0.70	1,971	5,559	-27	15.8		385.0(K-3)	3.32	-0.03	31,805	10,513	973	17.6

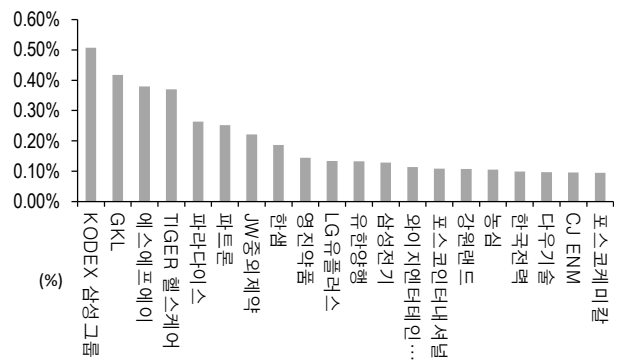
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,975,129	2,319.6	5,046,904	108,668	-1,274	38,220	-37,617	15.7	-12.0	-4.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아	83,800	-0.24	90.9	79.5	50,535	658	0.01%	-1,170	1,785	-615	195	-810
현대차	207,000	-0.96	123.3	76.6	49,168	1,951	0.03%	-691	2,456	-1,765	-1,075	-690
삼성 SDI	724,000	-0.69	113.7	73.0	26,706	-3,681	-0.01%	1,173	-3,841	2,668	1,283	1,416
NAVER	410,500	0.61	134.7	69.6	62,088	-789	0.01%	-652	169	390	-1,565	1,291
삼성전자	70,300	-0.14	500.2	65.5	1,032,795	-7,318	-0.05%	-6,508	-5,985	12,493	6,530	5,950
SK 이노베이션	257,000	-0.39	41.8	61.7	18,108	755	0.03%	26	-187	161	2,179	-1,980
현대제철	45,850	1.78	13.9	59.5	18,957	2,830	0.00%	2,246	1,237	-3,483	562	-4,045
LG 화학	806,000	-3.70	115.8	56.6	10,457	909	-0.10%	-53	293	-243	343	28
현대모비스	267,000	-0.56	22.0	56.2	9,874	269	-0.13%	708	-637	-71	110	147
카카오	128,000	-0.39	159.2	54.2	122,469	5,352	-0.07%	1,534	2,378	-4,391	1,250	-5,602

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터