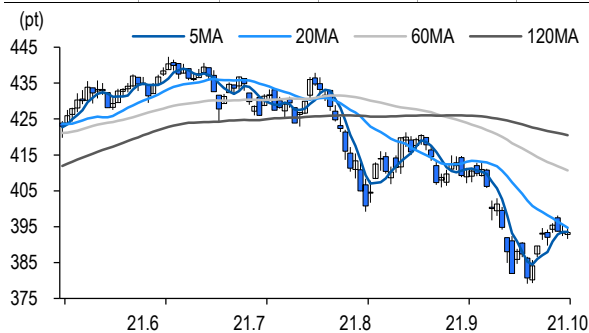


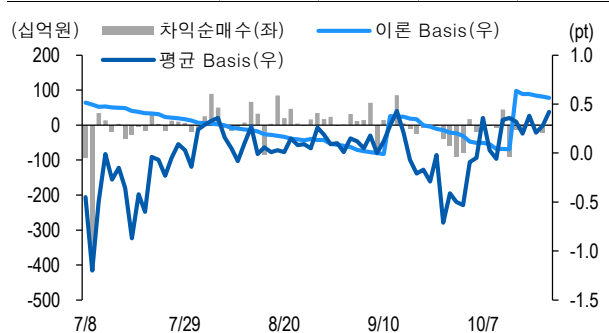
## 선물옵션시장 지표

2021.10.25

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.34	0.04	0.16	6,083.7	-
선물 12월물	394.40	0.25	1.00	22,356.6	271,604
선물 3월물	390.25	0.15	0.60	17.6	11,144
11월물(mini)	394.02	0.22	0.88	1,816.1	51,114
12월물(mini)	394.00	0.15	0.40	2.5	5,560



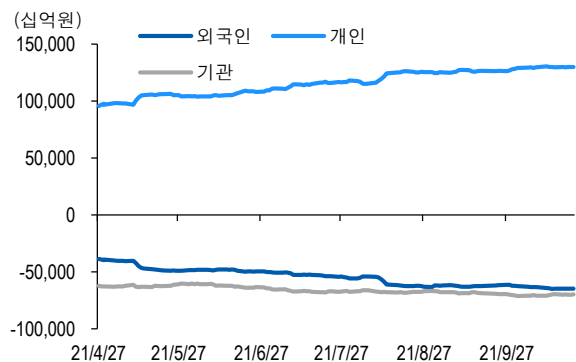
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.56	0.42	1.06	-0.04%
베이스(mini)	0.23	0.12	0.68	-0.03%
제1스프레드(SP)	-2.91	-3.85	-3.85	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	0.23	0.71	0.71	0.12%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-108.1	12.9	-95.1	0.0	-26.0	310.9	-131.0	-1.0	-1.7	47.5
개인	-67.2	11.3	-55.9	0.0	0.3	-53.1	23.3	-0.7	1.8	-2.9
기관	185.4	-29.1	156.2	-1.9	17.7	-238.9	108.3	2.1	-0.3	-45.2
금융투자	246.3	-105.7	140.6	0.0	41.2	-136.8	108.3	2.0	0.1	-15.0
투신	-18.6	5.7	-12.9	0.0	-9.0	-100.9	0.0	0.0	-0.1	-13.1
은행+보험+기타금융	13.0	76.4	89.4	0.0	0.9	-8.6	0.0	0.1	-0.3	-0.5
연기금+국가지자체	-46.5	-2.6	-49.1	-1.9	-12.7	7.4	0.0	0.0	0.0	-16.5
기타법인	-10.1	4.9	-5.3	0.0	-1.5	-18.8	-0.7	-0.3	0.2	0.5

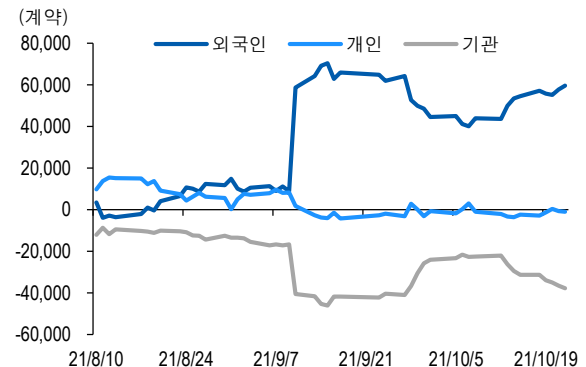
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

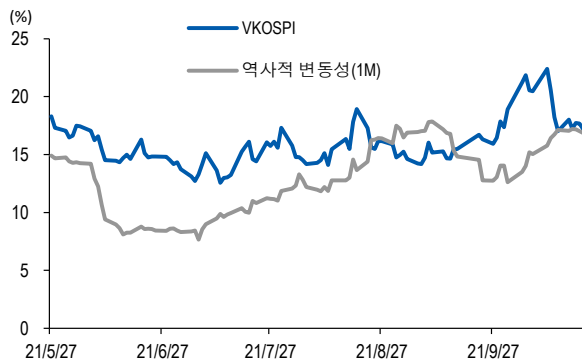
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	555,120	176.9	668,360	14.5%	지수옵션 전체	1,026,945	355.4	1,730,765
Put	471,825	178.5	1,062,405	16.0%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	17.20%(-0.48%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	2.85	-0.03	49,139	15,485	1,283	14.4	Put	395.0(K+1)	6.04	-0.82	5,308	5,125	112	14.1
	397.5(K+2)	3.88	0.01	18,760	6,690	595	14.9		392.5(K+0)	5.00	-0.72	6,787	4,496	143	14.7
	395.0(K+1)	5.12	0.08	10,232	8,131	282	15.4		390.0(K-1)	4.11	-0.67	12,070	11,979	1,659	15.3
	392.5(K+0)	6.55	0.15	5,202	5,068	490	15.9		387.5(K-2)	3.38	-0.59	10,915	4,743	-199	15.9
	390.0(K-1)	8.16	0.24	2,098	5,609	50	16.6		385.0(K-3)	2.78	-0.54	24,705	11,311	798	16.5

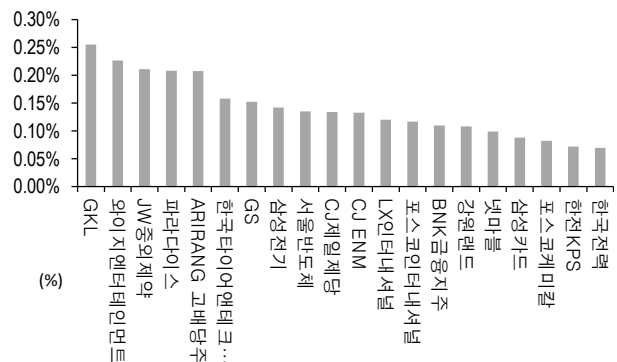
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,726,422	2,036.4	5,108,484	61,580	11,470	37,698	-49,904	47.5	-2.9	-45.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	207,500	0.24	66.3	88.8	49,813	645	-0.03%	606	-1,166	560	974	-414
기아	83,700	-0.12	45.1	80.0	51,253	718	0.01%	832	-683	-149	2,411	-2,560
삼성전자	70,600	0.43	466.6	79.1	1,060,262	27,467	0.03%	63,417	7,905	-71,447	-45,628	-26,293
NAVER	409,000	-0.37	120.5	75.3	62,622	534	-0.01%	-131	1,049	-1,050	-176	-764
카카오	128,000	0.00	181.7	72.4	126,078	3,609	-0.04%	2,004	2,333	-4,302	-2,948	0
LG 화학	819,000	1.61	83.3	63.6	10,838	381	-0.06%	464	-41	-421	103	-502
삼성에스디에스	153,500	-1.92	5.8	63.5	3,394	805	-0.32%	388	-953	565	505	60
GS 건설	41,300	-0.60	9.1	62.8	50,116	-1,406	0.05%	-138	-1,026	1,164	-578	1,742
SK 하이닉스	98,500	2.28	114.2	60.2	93,991	1,181	-0.08%	4,282	-5,127	846	4,111	-1,094
SK 이노베이션	256,500	-0.19	33.5	57.0	17,523	-585	0.02%	-49	-674	723	93	630

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터