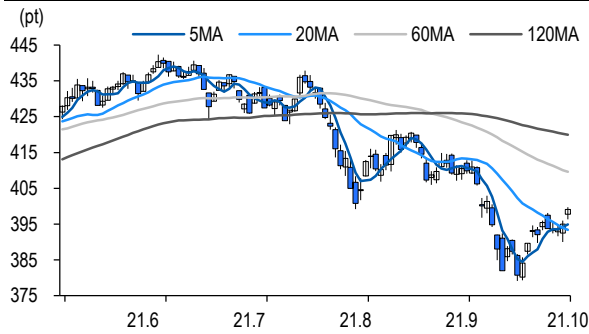


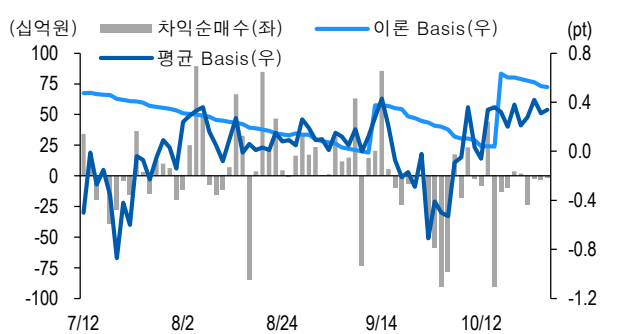
선물옵션시장 지표

2021.10.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	399.07	1.03	4.06	6,725.5	-
선물 12월물	399.35	0.88	3.50	19,004.0	272,277
선물 3월물	395.40	0.87	3.40	12.0	11,443
11월물(mini)	399.10	0.88	3.50	1,625.3	54,690
12월물(mini)	399.26	0.86	3.58	8.9	5,989



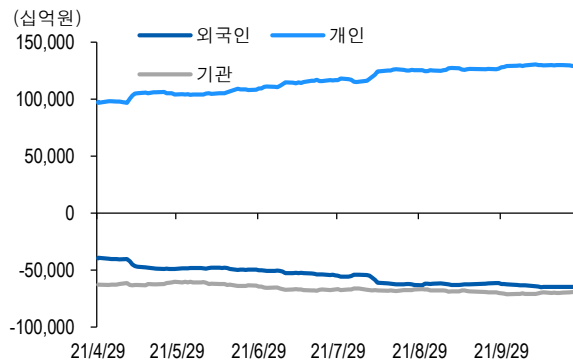
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.52	0.34	0.28	-0.05%
베이스(mini)	0.19	0.10	0.03	-0.02%
제1스프레드(SP)	-2.89	-3.89	-3.90	-0.25%
합성선물 베이스(ATM)	0.19	0.05	0.05	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	106.0	7.4	113.4	0.0	47.4	-379.9	180.2	-0.7	3.8	-42.2
개인	-440.6	3.7	-437.0	0.0	-1.8	92.8	-98.3	2.6	-4.2	141.8
기관	325.1	-20.0	305.1	-1.5	31.3	309.7	-74.7	-2.4	0.8	-99.9
금융투자	275.1	1.4	276.5	0.0	9.0	119.5	-74.6	-3.5	1.9	-78.5
투신	-0.9	14.9	14.0	-1.4	1.9	156.7	-0.1	0.1	0.0	-10.9
은행+보험+기타금융	3.4	-34.5	-31.2	0.0	-4.8	18.8	0.0	1.0	-1.2	-0.6
연기금+국가지자체	32.5	7.5	40.0	-0.1	25.7	14.8	0.0	0.0	0.0	-9.9
기타법인	9.6	8.9	18.5	0.0	0.1	-22.6	-7.3	0.4	-0.3	0.3

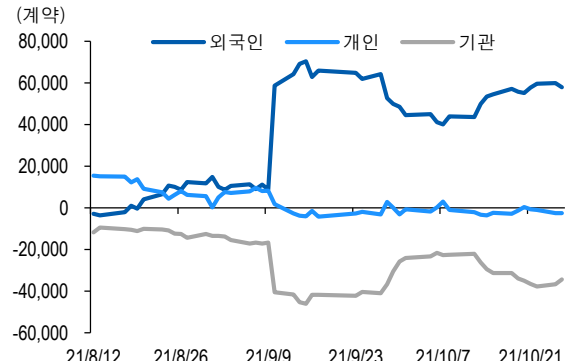
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

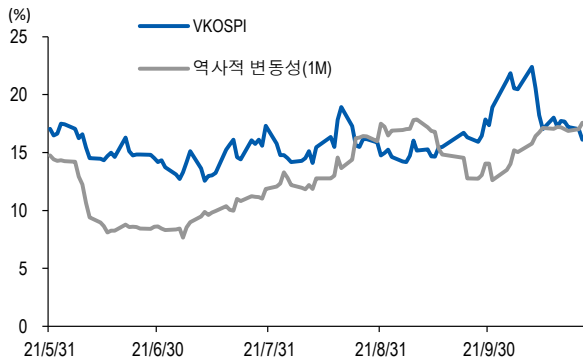
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	666,875	213.8	697,768	13.5%	지수옵션 전체	1,355,711	364.6	1,865,689
Put	688,836	150.8	1,167,921	15.8%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	16.11%(-0.92%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	3.24	1.09	46,725	11,740	903	13.6	Put	397.5(K+1)	4.13	-1.96	7,094	2,760	1,148	14.5
	400.0(K+2)	4.37	1.30	31,205	17,564	-266	13.7		395.0(K+0)	3.25	-1.70	13,085	8,023	1,431	14.9
	397.5(K+1)	5.76	1.57	9,371	8,375	188	14.1		392.5(K-1)	2.52	-1.49	20,767	7,043	2,358	15.3
	395.0(K+0)	7.37	1.82	4,866	9,105	133	14.5		390.0(K-2)	1.96	-1.25	48,283	25,121	8,416	15.8
	392.5(K-1)	9.17	2.05	2,893	4,529	-625	14.9		387.5(K-3)	1.51	-1.08	32,746	8,814	3,337	16.3

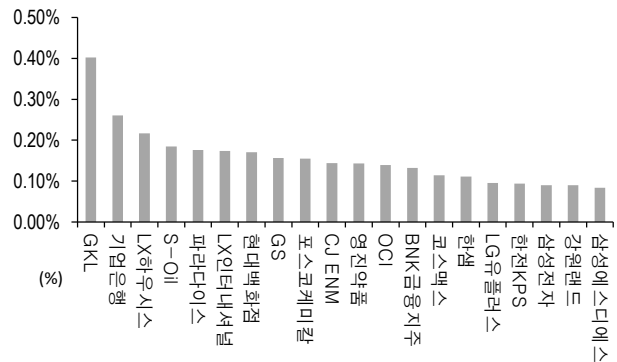
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,083,734	2,231.9	5,340,431	185,486	-70,818	180,500	-110,277	-42.2	141.8	-99.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	71,200	1.28	566.7	76.8	1,157,382	94,444	0.09%	-37,620	117,803	-80,246	-71,041	-20,440
BGF	5,790	-1.03	1.3	68.9	5,520	-15,128	-0.14%	5,532	-13,843	8,311	4,028	3,745
기아	84,900	0.47	57.2	66.9	52,663	-4,104	0.02%	-2,773	-2,724	5,457	114	4,715
현대차	214,500	1.42	108.5	65.5	50,602	-2,159	0.00%	-619	361	248	-363	-89
GS 건설	42,400	1.80	11.5	63.6	52,042	2,548	0.01%	-2,137	-957	3,094	-1,693	3,294
LG 화학	830,000	1.34	89.2	61.4	10,825	-204	-0.01%	-300	92	208	-136	177
현대제철	46,300	2.09	14.1	61.0	20,065	255	0.02%	4,213	-2,004	-2,209	-2,150	-59
SK 이노베이션	257,000	-0.19	41.4	58.1	16,791	-936	0.06%	-1,289	-89	1,398	-15	1,668
삼성 SDI	748,000	2.19	104.9	53.7	29,726	4,115	0.07%	-285	3,656	-3,354	-1,557	-1,777
LG 생활건강	1,322,000	-4.48	50.0	53.7	2,365	1,345	-0.11%	139	3	-142	1,005	146

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터