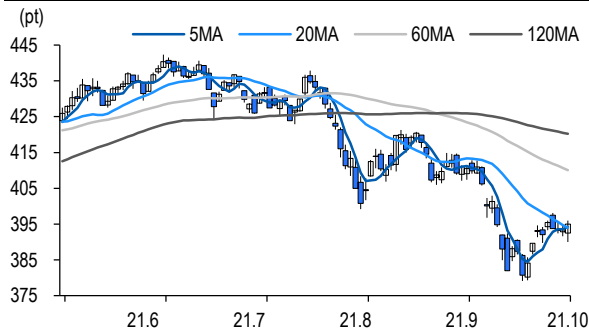


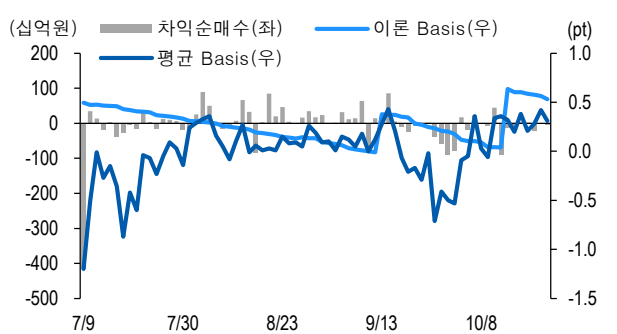
선물옵션시장 지표

2021.10.26

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.01	0.42	1.67	7,500.4	-
선물 12월물	395.85	0.37	1.45	19,908.5	272,587
선물 3월물	392.00	0.45	1.75	38.0	10,955
11월물(mini)	395.60	0.40	1.58	1,785.5	52,236
12월물(mini)	395.68	0.32	1.68	8.4	5,748

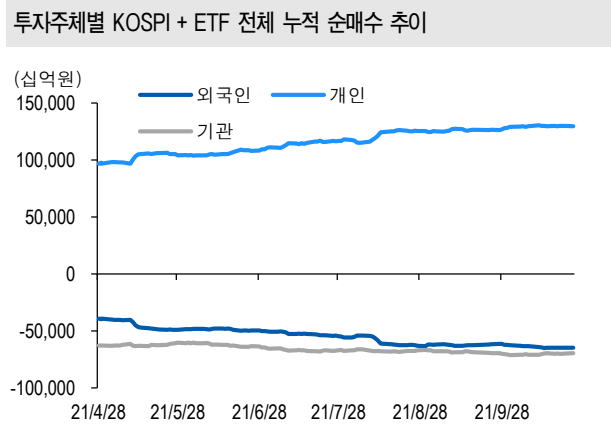


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.53	0.31	0.84	-0.06%
베이스스(mini)	0.20	0.04	0.59	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.90	-3.80	-3.80	-0.23%
합성선물 베이스스(ATM)	0.20	0.60	0.60	0.10%

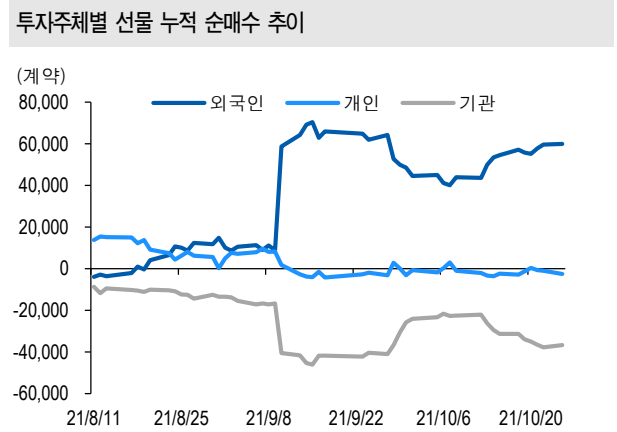


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	36.5	-44.4	-7.8	0.0	164.2	46.6	-17.1	-1.6	0.5	-0.8
개인	-304.7	36.3	-268.4	0.0	-0.2	-156.2	6.8	0.9	-1.8	20.5
기관	258.8	9.5	268.4	-3.3	-8.1	94.7	10.4	0.5	1.4	-22.3
금융투자	308.2	-1.9	306.3	-3.4	3.9	17.0	10.2	0.6	1.3	-4.5
투신	-1.9	-2.2	-4.1	0.0	4.5	82.9	0.2	0.0	0.0	0.0
은행+보험+기타금융	-22.6	16.7	-6.0	0.0	-5.2	12.5	0.0	-0.1	0.1	-1.0
연기금+국가자재	-34.2	-1.8	-36.0	0.0	-10.2	-17.7	0.0	0.0	0.0	-16.9
기타법인	9.3	-1.5	7.9	0.0	-0.1	14.9	0.0	0.2	0.0	2.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



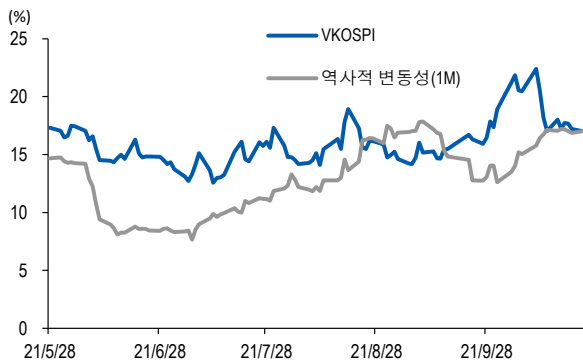
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	571,629	181.4	687,108	14.5%	지수옵션 전체	1,194,520	363.9	1,795,793
Put	622,891	182.5	1,108,685	16.3%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	17.03%(-0.17%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	3.07	0.22	55,058	17,830	2,345	14.5	Put	395.0(K+1)	4.95	-1.09	5,789	6,592	1,467	14.5
	397.5(K+2)	4.19	0.31	23,509	8,187	1,497	15.0		392.5(K+0)	4.01	-0.99	7,082	4,685	189	15.1
	395.0(K+1)	5.55	0.43	13,811	8,972	841	15.5		390.0(K-1)	3.21	-0.90	17,483	16,705	4,726	15.6
	392.5(K+0)	7.12	0.57	5,930	5,154	86	16.2		387.5(K-2)	2.59	-0.79	15,674	5,477	734	16.2
	390.0(K-1)	8.83	0.67	2,497	5,817	208	16.8		385.0(K-3)	2.07	-0.71	30,520	13,104	1,793	16.8

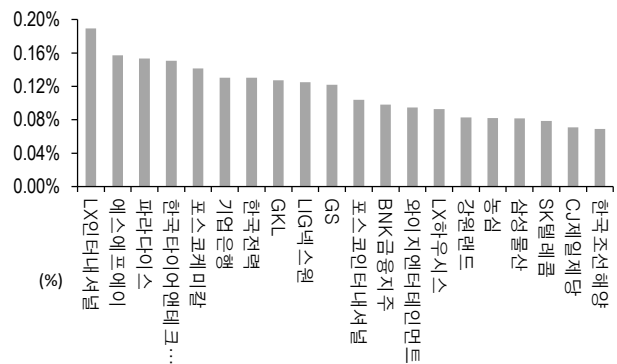
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,628,283	2,408.7	5,154,945	46,461	43,935	174	-46,531	-0.8	20.5	-22.3

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	0.85	10.0	100.2	49,494	-622	0.05%	2,213	-803	-1,410	-1,797	387
현대제철	45,350	1.80	20.2	93.3	19,810	210	0.01%	2,946	3,355	-6,301	-2,616	-3,685
삼성전자	70,300	-0.42	524.6	75.8	1,062,938	2,676	0.03%	-10,814	15,125	-7,012	-10,664	4,745
현대차	211,500	1.93	91.3	67.2	52,761	2,948	-0.02%	-664	2,553	-1,899	-2,328	429
NAVER	403,000	-1.47	125.0	67.0	62,553	-69	0.01%	-133	281	-300	-1,149	849
기아	84,500	0.96	56.1	65.0	56,767	5,514	0.01%	1,695	4,057	-5,662	-2,538	-3,124
다우기술	23,350	0.43	1.2	64.3	4,432	-746	-0.08%	58	70	-128	-208	80
SK 이노베이션	257,500	0.39	48.3	61.3	17,727	204	0.01%	676	-25	-648	-2	-651
LG 화학	819,000	0.00	82.2	59.5	11,029	191	-0.03%	109	-34	-74	45	-353
영진약품	4,840	0.21	0.7	58.9	7,349	751	-0.25%	1,546	2	-1,548	-1,586	38

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터