

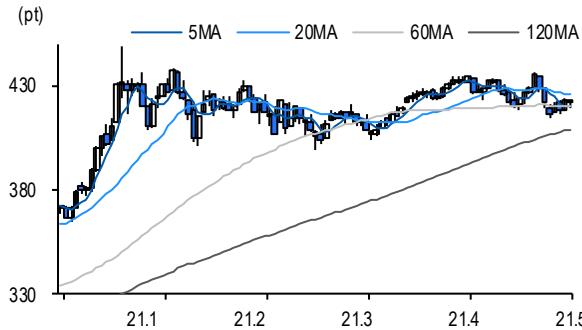


## 선물옵션시장 지표

2021.5.21

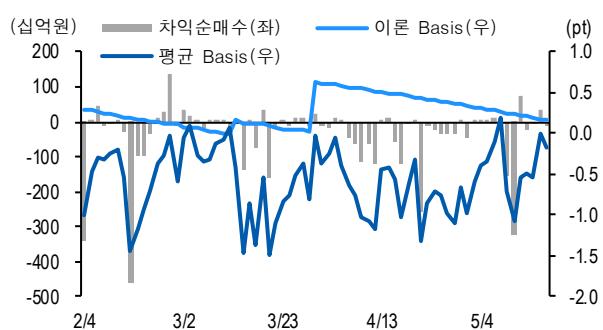
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	421.68	-0.33	-1.41	9,291.8	-
선물 6월물	421.40	-0.35	-1.50	25,730.8	232,458
선물 9월물	421.20	-0.30	-1.25	51.6	5,731
6월물(mini)	421.54	-0.32	-1.42	1,740.0	23,118
7월물(mini)	420.90	-0.38	-1.60	2.9	395



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.16	-0.17	-0.28	-0.08%
베이시스(mini)	0.16	-0.17	-0.14	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.05	-0.48	-0.50	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.16	-0.23	-0.23	-0.09%



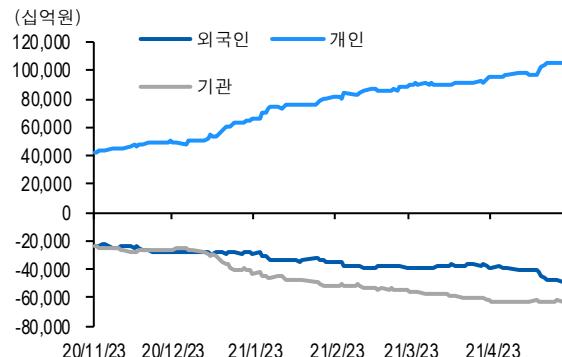
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

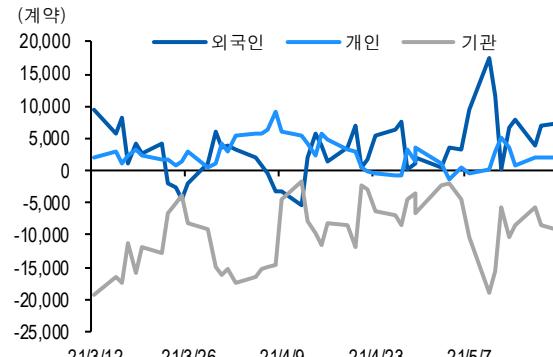
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-651.7	32.0	-619.7	0.0	-506.8	24.5	8.2	1.4	-1.4	-44.7
개인	858.5	17.6	876.2	0.0	-1.0	20.9	-3.4	-0.1	0.3	59.0
기관	-201.1	-53.0	-254.0	-8.7	32.3	-75.9	-5.1	-0.8	1.3	-18.6
금융투자	-92.7	-57.6	-150.2	-2.5	26.3	140.7	-6.3	-0.4	0.9	-40.3
투신	-13.4	0.6	-12.7	0.0	-7.1	-228.4	1.3	0.0	0.0	21.0
은행+보험+기타금융	-31.6	3.3	-28.4	0.0	-0.7	6.1	0.0	-0.5	0.4	-0.6
연기금+국가지자체	-37.3	0.6	-36.7	-6.3	-2.0	5.7	-0.2	0.0	0.0	1.2
기타법인	-5.7	3.4	-2.4	0.0	-0.4	30.5	0.3	-0.4	-0.2	4.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	545,561	205.1	624,866	15.8%	지수옵션 전체	1,182,957	416.0	1,813,285							
Put	637,396	210.9	1,188,419	18.1%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	19.12%(+0.89%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	430.0(K+3)	3.29	-0.49	32,006	13,652	1,064	15.8	Put	425.0(K+1)	8.77	0.79	2,482	6,214	113	17.1
	427.5(K+2)	4.18	-0.61	10,225	6,154	847	15.9		422.5(K+0)	7.50	0.74	3,783	2,455	201	17.3
	425.0(K+1)	5.24	-0.62	7,118	9,125	567	16.2		420.0(K-1)	6.39	0.66	7,176	9,027	275	17.7
	422.5(K+0)	6.45	-0.71	6,382	4,443	951	16.4		417.5(K-2)	5.44	0.61	3,776	3,595	63	18.0
	420.0(K-1)	7.82	-0.79	5,319	10,560	236	16.6		415.0(K-3)	4.64	0.54	6,513	8,328	184	18.5

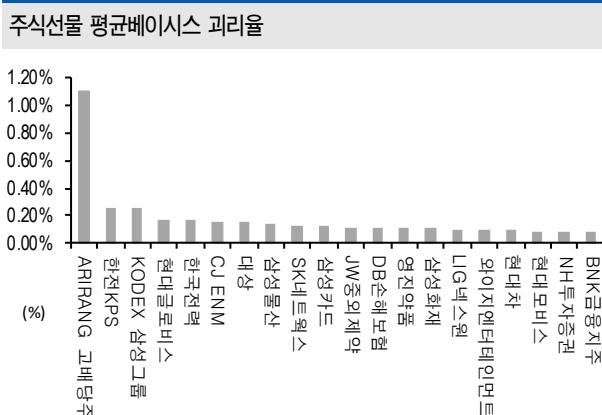
---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

---

자료: KBX 유파티<sup>증권</sup> 리서치센터