

Daily truewarrant List

기준일 :2011.10.05

삼성전자

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571G21	P	중도		12%	230	1,188,500	750,000	-5.18	41.2	-0.28	0.01	159
571995	C	공격적		10%	120	1,887,420	930,000	10.02	41.5	0.32	0.00	61
571F95	C	중도		9%	210	200	920,000	7.03	45.1	0.39	0.00	96
571G39	C	공격적		7%	155	830,480	900,000	10.15	40.8	0.37	0.01	54
571G20	C	중도		1%	265	53,130	850,000	5.19	41.7	0.54	0.00	159
571G18	C	중도		0%	315	6,830,920	840,000	6.52	39.6	0.54	0.00	103
571942	P	중도		1%	265	21,270	850,000	-6.79	42.0	-0.48	0.00	61
571H07	C	중도		3%	275	160,330	820,000	6.51	40.7	0.61	0.00	82
571J15	C	보수적		5%	535	214,700	800,000	4.95	42.6	0.63	0.01	138
571H14	C	중도		7%	325	30,020	780,000	5.18	45.8	0.67	0.00	96
571H58	C	보수적		10%	425	0	760,000	4.98	34.1	0.72	0.00	166
571J09	C	보수적		12%	540	490	740,000	4.33	45.7	0.73	0.00	124

하이닉스

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571K07	C	보수적		25%	245	870,200	25,000	3.18	85.6	0.46	0.09	159
571K01	C	보수적		20%	200	360,200	24,000	3.45	84.5	0.46	0.08	131
571H09	C	보수적		15%	135	3,599,890	23,000	4.69	74.8	0.42	0.08	82
571J46	P	보수적		11%	260	1,590,140	18,000	-2.44	73.0	-0.32	0.10	159
571J70	C	보수적		10%	250	6,554,740	22,000	3.35	81.6	0.52	0.08	131
571J19	C	보수적		5%	355	4,462,810	21,000	2.93	81.0	0.58	0.09	166
571J10	C	보수적		0%	315	300,310	20,000	3.05	86.0	0.60	0.08	124
571H60	P	보수적		0%	260	86,150	20,000	-3.63	65.1	-0.43	0.11	82
571J00	C	보수적		5%	290	150,800	19,000	3.07	91.9	0.64	0.07	96
571G00	P	보수적		18%	545	0	24,500	-3.13	44.6	-0.78	0.11	96
571A74	P	보수적		26%	610	0	27,000	-2.38	61.0	-0.86	0.09	61

기아차

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571J52	C	중도		19%	145	1,854,080	80,000	6.47	54.2	0.31	0.05	96
571H86	C	중도		12%	160	3,796,220	75,000	7.22	53.4	0.36	0.05	68
571J26	C	중도		12%	240	0	75,000	5.52	62.0	0.42	0.05	82
571J66	C	보수적		4%	200	937,910	70,000	4.79	55.7	0.51	0.03	117
571A76	P	보수적		4%	235	842,570	70,000	-3.57	58.8	-0.50	0.03	90

현대차

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571A09	C	중도		22%	165	18,020	240,000	6.78	63.1	0.28	0.02	68
571J35	C	보수적		17%	170	400,000	230,000	4.99	64.4	0.39	0.01	103
571J50	C	중도		17%	200	2,341,120	230,000	5.47	63.9	0.37	0.02	90
571H37	C	중도		17%	120	96,000	230,000	6.23	64.6	0.35	0.01	68
571J29	C	중도		12%	150	1,433,200	220,000	5.50	62.0	0.42	0.01	82
571H34	C	중도		12%	135	300,280	220,000	6.29	64.0	0.39	0.01	61
571878	P	중도		2%	175	2,541,220	200,000	-5.41	64.1	-0.48	0.01	40

삼성전기

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571H56	C	보수적		13%	250	3,046,860	79,000	4.22	58.5	0.46	0.03	166
571J14	C	보수적		4%	545	400	73,000	3.53	72.3	0.55	0.05	138
571J75	C	보수적		0%	285	0	70,000	4.18	55.3	0.57	0.03	145
571J03	C	보수적		4%	500	600	67,000	3.47	75.1	0.62	0.04	112
571A15	P	보수적		22%	750	200	90,000	-3.73	0.0	-1.00	0.04	61

LG전자

종목코드	유형	투자성향	Moneyiness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571G80	C	중도		15%	190	3,320,640	80,000	6.45	61.5	0.35	0.05	68
571H02	C	중도		8%	160	3,588,600	75,000	5.83	61.8	0.45	0.03	68
571J78	C	보수적		7%	355	100,100	74,500	3.24	65.3	0.55	0.03	201
571J07	C	보수적		1%	520	200	70,000	3.85	65.0	0.58	0.05	124
571J65	C	보수적		2%	325	230	68,000	3.87	64.3	0.60	0.03	117
571J01	C	보수적		6%	510	0	65,000	4.47	52.9	0.66	0.05	103

571J51	C	보수적	11%		320	0	62,000	4.80	46.5	0.74	0.03	90
571F63	P	보수적	13%		1,075	0	80,000	-1.58	127.2	-0.49	0.05	68

KB금융

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571H97	C	중도		22%	105	0	47,000	5.87	62.3	0.32	0.05	90
571H18	C	중도		17%	175	4,282,260	45,000	5.69	53.4	0.37	0.07	117
571J38	C	보수적		11%	170	0	43,000	4.63	61.7	0.45	0.05	117
571J72	C	보수적		4%	195	840,560	40,000	4.27	56.5	0.54	0.04	138

LG

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571H98	C	보수적		21%	125	200	70,000	4.94	74.3	0.36	0.03	90
571H19	C	보수적		20%	195	2,066,220	69,000	4.59	68.9	0.39	0.04	117
571J36	C	보수적		4%	190	979,880	60,000	4.02	68.5	0.53	0.03	117

LG디스플레이

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571H88	C	중도		16%	100	3,108,520	21,000	5.54	64.3	0.38	0.08	82
571J44	C	보수적		10%	245	4,577,660	20,000	2.99	87.3	0.54	0.08	159
571H59	P	보수적		9%	340	1,250,080	20,000	-3.34	59.7	-0.57	0.11	82

* Moneyness: 현재 시점에 행사할 수 있다고 가정했을 때 워런트가 ITM(내가격)이면 가치가 있고 (내재가치>0), ATM(등가격)이거나 OTM(외가격)이면 가치가 없습니다 (내재가치=0).
 ** Delta: 기초자산이 1원 움직일 때 해당 ELW가 몇 원 변하는지 알려주는 지표로, 델타가 클수록 기초자산의 변동폭과 비슷하게 움직입니다.

