

Daily truewarrant List

기준일 :2011.11.17

하이닉스

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M22	C	중도		12%	190	4,980,850	26,000	5.16	66.0	0.42	0.10	88
571K07	C	보수적		8%	235	1,861,880	25,000	4.19	67.5	0.50	0.09	116
571L34	P	보수적		5%	245	1,678,860	22,000	-3.51	70.4	-0.37	0.10	88
571K01	C	보수적		3%	200	1,847,680	24,000	4.57	67.7	0.53	0.08	88
571J70	C	보수적	5%		270	22,140	22,000	4.32	63.4	0.63	0.08	88
571G00	P	보수적	5%		330	10,030	24,500	-4.22	64.2	-0.55	0.11	53
571J19	C	보수적	9%		395	0	21,000	3.59	62.7	0.68	0.09	123
571J10	C	보수적	14%		350	0	20,000	3.95	62.7	0.75	0.08	81
571J00	C	보수적	18%		350	10,200	19,000	3.69	76.5	0.80	0.07	53

삼성전자

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M39	C	중도		12%	235	7,583,590	#####	7.13	42.7	0.36	0.00	116
571M29	C	중도	0%		270	3,894,200	980,000	6.10	45.4	0.54	0.00	95
571M30	C	중도	4%		280	1,489,750	940,000	5.81	43.9	0.61	0.00	95
571K18	C	중도	11%		565	127,870	870,000	5.49	48.1	0.75	0.00	60
571J15	C	보수적	18%		1,025	0	800,000	3.91	51.6	0.82	0.01	95
571J09	C	보수적	24%		1,000	0	740,000	3.16	68.9	0.85	0.00	81
571M92	C	중도	2%		235	918,210	960,000	5.35	44.0	0.58	0.00	123
571H14	C	보수적	20%		665	0	780,000	3.66	73.5	0.83	0.00	53
571L13	C	중도	7%		385	62,400	910,000	6.46	40.4	0.69	0.00	74
571F95	C	중도	6%		475	0	920,000	6.04	53.6	0.65	0.00	53
571L17	C	중도	2%		365	120	960,000	6.49	42.3	0.58	0.00	88
571L25	C	중도		2%	410	300	#####	6.11	45.3	0.51	0.01	102
571G18	C	중도	14%		705	84,500	840,000	5.04	48.6	0.81	0.00	60
571G20	C	보수적	13%		485	120	850,000	4.67	40.9	0.77	0.00	116

기아차

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M31	C	중도		15%	135	630,260	85,000	7.08	49.1	0.32	0.04	95
571K48	C	중도		13%	175	480,020	83,000	5.62	45.9	0.41	0.03	151
571K49	C	중도		5%	195	100,120	77,000	5.14	45.3	0.50	0.03	151
571M58	C	중도	1%		190	505,020	73,000	5.48	47.8	0.57	0.03	102
571K82	C	보수적	9%		260	1,040	67,000	4.92	54.5	0.70	0.03	74
571K83	C	중도		2%	185	2,439,110	75,000	6.65	48.9	0.51	0.03	74
571M89	C	보수적	4%		205	1,090,300	71,000	4.82	49.5	0.61	0.02	116
571J52	C	공격적		9%	130	2,041,430	80,000	8.99	48.8	0.35	0.05	53
571K95	C	중도		7%	180	1,991,500	79,000	6.27	49.4	0.44	0.04	95
571J66	C	중도	5%		235	82,020	70,000	5.52	52.0	0.63	0.03	74
571L32	C	중도		9%	225	20	80,000	5.76	46.4	0.44	0.04	130
571L80	C	중도		15%	250	120	84,500	5.65	50.7	0.38	0.05	130
571L37	P	보수적		13%	165	400,320	65,000	-4.96	54.1	-0.28	0.04	102
571L94	P	보수적		5%	190	1,258,100	70,000	-4.32	54.6	-0.37	0.03	102

LG전자

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571J01	C	중도	3%		395	925,810	63,523	5.13	64.0	0.60	0.05	60
571J07	C	중도		4%	335	240,740	68,409	5.07	63.5	0.51	0.05	81
571K50	C	보수적		4%	240	813,030	68,409	3.82	61.7	0.55	0.03	151
571J51	C	중도	8%		250	20	60,591	5.53	60.4	0.69	0.03	47
571K94	C	중도		7%	120	0	70,364	6.60	46.5	0.44	0.03	95
571K97	C	중도		18%	130	300,100	77,205	5.94	56.1	0.35	0.03	102
571J65	C	중도		1%	205	46,020	66,455	5.29	61.0	0.54	0.03	74
571J78	C	보수적		11%	230	4,083,770	72,807	4.19	58.3	0.48	0.03	158
571L73	C	중도		22%	170	10	80,136	5.38	58.0	0.34	0.04	123
571L98	P	보수적		3%	380	2,693,590	63,523	-3.42	59.3	-0.39	0.05	123

현대차

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M44	C	보수적		15%	155	1,070,020	260,000	4.87	53.7	0.42	0.01	151
571K34	C	보수적		7%	305	6,200	210,000	4.16	55.4	0.66	0.01	116

571K20	C	보수적	12%		345	0	200,000	3.44	76.6	0.70	0.01	88
571J35	C	중도		2%	200	120	230,000	6.40	55.4	0.51	0.01	60
571G95	C	중도		10%	220	3,549,790	250,000	5.36	54.1	0.43	0.01	116
571J50	C	중도		2%	230	225,290	230,000	7.39	55.2	0.50	0.02	47
571K54	P	보수적		13%	130	400,300	200,000	-4.04	57.8	-0.29	0.01	123

POSCO

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571K29	C	중도		7%	180	1,953,120	420,000	6.97	45.1	0.40	0.01	102
571K38	C	중도		15%	190	1,693,140	450,000	6.76	43.7	0.33	0.01	137
571L04	C	보수적	8%		270	3,500	360,000	4.73	46.1	0.65	0.01	130
571K03	C	중도	0%		130	150	390,000	6.30	43.8	0.52	0.00	102
571L91	C	보수적		2%	390	10,720	400,000	4.52	48.3	0.53	0.01	179
571K55	P	중도		9%	160	518,330	360,000	-5.06	43.0	-0.34	0.01	137

LG화학

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571J47	C	중도		7%	140	1,564,020	380,000	6.86	66.7	0.42	0.01	47
571K36	C	보수적	1%		380	2,000	350,000	4.09	62.9	0.58	0.01	116
571K21	C	보수적	10%		370	120	320,000	3.92	67.1	0.68	0.01	88
571J54	C	중도		13%	190	26,810	400,000	5.55	75.6	0.40	0.01	60
571J85	C	중도		11%	150	1,518,120	394,000	6.37	65.2	0.38	0.01	60
571L28	C	보수적		4%	370	25,580	370,000	3.87	67.3	0.54	0.01	130
571L97	P	보수적		11%	380	20	320,000	-3.03	72.8	-0.32	0.01	116

SK이노

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M88	C	보수적		13%	225	1,013,340	200,000	4.36	69.0	0.44	0.01	116
571J32	C	중도		8%	130	2,353,060	190,000	5.90	67.3	0.43	0.01	60
571J48	C	중도		2%	205	48,880	180,000	6.41	65.6	0.50	0.02	47
571K37	C	보수적	9%		365	20,000	160,000	3.68	63.9	0.67	0.01	116
571K23	C	보수적	15%		365	0	150,000	3.80	62.7	0.75	0.01	88
571K88	C	보수적	21%		635	0	140,000	2.77	92.7	0.77	0.01	88
571L82	C	보수적	4%		325	200	170,000	3.68	60.2	0.62	0.01	151
571A75	P	보수적	2%		315	3,020	180,000	-4.11	75.7	-0.49	0.02	47
571L96	P	보수적		18%	175	2,415,420	150,000	-3.54	68.4	-0.27	0.01	116

LG디스플레이

종목코드	유형	투자성향	Moneyness		현재가	거래량	행사가격	레버리지	내재변동성	델타	전환비율	잔존만기
			ITM	OTM								
571M37	C	보수적		9%	260	2,978,080	27,000	4.47	65.7	0.47	0.10	116
571M23	C	보수적		5%	245	823,750	26,000	4.93	65.6	0.49	0.10	88
571J04	C	보수적	7%		320	20	23,000	4.45	67.5	0.64	0.09	74
571J44	C	보수적	19%		415	160	20,000	3.55	55.8	0.79	0.08	116
571K87	C	보수적	23%		445	200	19,000	3.61	54.1	0.87	0.08	88
571L12	C	중도	11%		350	0	22,000	5.10	52.9	0.72	0.10	69
571L14	C	보수적	3%		320	127,960	24,000	4.55	64.1	0.59	0.10	88
571L67	C	보수적		1%	325	79,020	25,000	4.20	64.2	0.55	0.10	116
571M00	P	보수적		8%	325	0	23,000	-2.70	67.4	-0.35	0.10	151

* 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.

