

퀵스트라이크 에센셜

CME 그룹 전용으로 고안된 옵션 가격산정 및 분석 도구



이용자 안내서

옵션 가격산정, 분석 및 글로벌 협업 도구

CME 그룹은 퀵스트라이크와 제휴하여 고객들에게 상호 대화식 옵션 가격 산정 및 분석 도구를 제공하게 되어 매우 기쁩니다. 이 도구는 저희 옵션 상품에 대한 광범위한 조명을 제공함과 함께 현재 및 과거의 (행사가격별) 변동성, 간략한 거래량 및 미결제약정 정보, 델타 시트, 옵션 가격 분석, 스프레드 분석 및 리스크 그래프 등에 대한 시각화된 정보를 제공합니다.

퀵스트라이크는 사용 도중에 끊기지 않고 써 보실 수 있도록 어느 PC 나, 맥 컴퓨터, 아이패드, 스마트폰 등 다음 모든 브라우저에서 쉽게 실행 가능합니다:

PC: 인터넷 익스플로러 7 이상, 크롬, 모질라 파이어폭스, 사파리

맥 컴퓨터: 크롬, 모질라 파이어폭스, 사파리

아이패드: 사파리 권장

안드로이드폰: 전용 브라우저,

모질라; 아이폰: 전용 브라우저

더 자세한 정보는 cmegroup.com/quikstrike 를 방문하여 주십시오.

가격산정 시트

표준 가격 산정 시트(Standard Pricing Sheet) > 이 시트에서는 현재의 변동성(해당 옵션의 최근 결제가격 내재변동성) 및 기초자산 선물 상품의 최종 결제가격을 기준으로 콜과 풋의 가격을 보여 줍니다. 각 옵션별로 현재가격과 전일결제가격이 표시됩니다.

콜과 풋의 델타, 감마, 베가, 세타 수치가 각 행사가별로 내재변동성(금리상품의 경우에는 대체 변동성)과 함께 제공됩니다. 옵션 민감도 수치들에 대한 설명은 칼럼 상단의 해당 내용을 클릭하시면 팝업창이 열리면서 자세히 보실 수 있습니다. 예시는 현재의 등가격 행사가격대의 민감도 수치를 이용하여 더욱 실용적인 계산을 도와 드립니다.

LEM4 Prices (8 DTE) vs 136.150 (+0.000)										Settles as of 5/28/2014		
Strikes: 10												
Volatility	Delta	Call Settle	Call	Strike	Put	Put Settle	Delta	Straddle	Gamma	Vega	Theta	
22.78	100	10.150	10.150	126	0.016	0.000	-1	10.166	0.60	0.01	-0.01	
20.75	100	9.150	9.150	127	0.016	0.000	-1	9.166	0.71	0.01	-0.01	
18.71	100	8.175	8.150	128	0.016	0.025	-1	8.166	0.86	0.01	-0.01	
16.67	100	7.175	7.150	129	0.017	0.025	-1	7.167	1.06	0.01	-0.01	
16.43	95	6.200	6.159	130	0.036	0.050	-3	6.194	1.93	0.01	-0.01	
14.16	95	5.200	5.167	131	0.036	0.050	-3	5.203	2.53	0.01	-0.01	
11.86	95	4.200	4.174	132	0.037	0.050	-4	4.211	3.47	0.02	-0.01	
9.49	94	3.200	3.180	133	0.038	0.050	-5	3.218	5.15	0.02	-0.01	
8.43	90	2.250	2.229	134	0.081	0.100	-10	2.310	10.33	0.04	-0.02	
7.95	77	1.400	1.369	135	0.220	0.250	-23	1.589	19.12	0.06	-0.03	
7.30	54	0.700	0.665	136	0.515	0.550	-46	1.179	26.95	0.08	-0.04	
7.44	29	0.300	0.269	137	1.118	1.150	-71	1.387	22.74	0.07	-0.03	
8.52	14	0.150	0.126	138	1.974	2.000	-85	2.100	13.19	0.05	-0.02	
9.43	7	0.075	0.059	139	2.904	2.925	-92	2.962	7.06	0.03	-0.02	
10.84	4	0.050	0.037	140	3.876	3.900	-94	3.913	4.10	0.02	-0.01	
11.50	2	0.025	0.017	141	4.850	4.875	-100	4.867	2.12	0.01	-0.01	
13.41	2	0.025	0.017	142	5.850	5.875	-100	5.867	1.60	0.01	-0.01	
15.27	2	0.025	0.017	143	6.850	6.875	-100	6.867	1.26	0.01	-0.01	
17.08	1	0.025	0.017	144	7.850	7.875	-100	7.867	1.02	0.01	-0.01	
18.86	1	0.025	0.016	145	8.850	8.875	-100	8.866	0.85	0.01	-0.01	
20.63	1	0.000	0.016	146	9.850	9.850	-100	9.866	0.73	0.01	-0.01	
Volatility	Delta	Call Settle	Call	Strike	Put	Put Settle	Delta	Straddle	Gamma	Vega	Theta	

도표 3. 생우 가격산정 시트

콜 시트(Call Sheet) > 결제 기준 콜 가격과 민감도 수치들을 현재의 변동성 및 베이스 변동성(금리상품)과 함께 보여 줍니다. 이 가격산정 시트는 표준 가격산정 시트와 유사합니다. 가격산정시트가 민감도 수치로 표현되어 산정되며 풋 및 풋 델타를 제외한 모든 정보가 이용 가능합니다.

풋 시트(Put Sheet) > 결제가격 기준 풋 가격 및 민감도 수치들을 현재의 변동성 및 베이스 변동성(금리상품)과 함께 보여 드립니다. 이 가격산정 시트는 표준가격산정 시트와 유사합니다. 가격산정시트가 민감도 수치로 표현되어 산정되며 콜 및 콜 델타를 제외한 모든 정보가 이용 가능합니다.

LEM4 Puts (8 DTE) vs 136.150 (+0.000)								Settles as of 5/28/2014
Strikes: 5								
Volatility	Strike	Put	Delta	Gamma	Vega	Theta		
14.16	131	0.036	-3	2.53	0.01	-0.01		
11.86	132	0.037	-4	3.47	0.02	-0.01		
9.49	133	0.038	-5	5.15	0.02	-0.01		
8.43	134	0.081	-10	10.33	0.04	-0.02		
7.95	135	0.220	-23	19.12	0.06	-0.03		
7.30	136	0.515	-46	26.95	0.08	-0.04		
7.44	137	1.118	-71	22.74	0.07	-0.03		
8.52	138	1.974	-85	13.19	0.05	-0.02		
9.43	139	2.904	-92	7.06	0.03	-0.02		
10.84	140	3.876	-94	4.10	0.02	-0.01		

도표 4. 생우 풋 가격산정시트

미결제약정 및 거래량

Calls				Puts				Combined			
Open Interest	Strikes Up	Strikes Down	Net Change	Open Interest	Strikes Up	Strikes Down	Net Change	Open Interest	Strikes Up	Strikes Down	Net Change
3,989	0	2	(19)	8,242	1	0	2	12,231	1	2	(17)

Top 10 Change					Top 10 Change					Top 10 Change							
Strike Price	Volume	Open Interest			Change	Strike Price	Volume	Open Interest			Change	Strike Price	Type	Volume	Open Interest		
		Prior	5/28/2014	Change				Prior	5/28/2014	Change					Prior	5/28/2014	Change
22.25	0	101	86	(15)	22.50	2	87	89	2	22.25	C	0	101	86	(15)		
22.00	0	244	240	(4)	8.50	0	0	0		22.00	C	0	244	240	(4)		
8.50	0	0	0		8.75	0	0	0		22.50	P	2	87	89	2		
8.75	0	0	0		9.00	0	0	0		8.50	C	0	0	0			
9.00	0	0	0		9.25	0	0	0		8.50	P	0	0	0			
9.25	0	0	0		9.50	0	0	0		8.75	C	0	0	0			
9.50	0	0	0		9.75	0	0	0		8.75	P	0	0	0			
9.75	0	0	0		10.00	0	0	0		9.00	C	0	0	0			
10.00	0	0	0		10.25	0	0	0		9.00	P	0	0	0			
10.25	0	0	0		10.50	0	0	0		9.25	C	0	0	0			

도표 5.3 등급 우유 거래활발 행사가격

거래 활발 계약 (Most Actives) > 현재의 만기월을 대상으로 콜 및 풋 별로, 그리고 콜과 풋을 합하여 거래량 상위 10 개 계약의 미결제약정을 보여 줍니다. 현 만기월의 (적용 가능한 경우) 논리적 계약군에 대한 개요와 전반적 상품의 개황을 보여 드립니다.

각 군별로 총 미결제약정과 행사가격 수 및 미결제약정 합계치의 증가/감소 등 지표들을 보여 드립니다.

Calls						Puts					
Strike Price	Volume	Open Interest		Change	Change Chart	Strike Price	Volume	Open Interest		Change	Change Chart
		Prior	5/28/2014					Prior	5/28/2014		
20.00	0	131	131			20.00	0	454	454		
20.25	0	56	56			20.25	0	92	92		
20.50	0	125	125			20.50	0	610	610		
20.75	0	40	40			20.75	0	46	46		
21.00	0	181	181			21.00	0	345	345		
21.25	0	82	82			21.25	0	178	178		
21.50	0	217	217			21.50	0	263	263		
21.75	0	91	91			21.75	0	77	77		
22.00	0	244	240	(4)	I	22.00	0	360	360		
22.25	0	101	86	(15)	I	22.25	0	135	135		
22.50	0	306	306			22.50	2	87	89	2	I
22.75	0	213	213			22.75	0	151	151		
23.00	0	379	379			23.00	0	70	70		
23.25	0	76	76			23.25	0	0	0		
23.50	0	261	261			23.50	0	0	0		
23.75	0	31	31			23.75	0	0	0		
24.00	0	53	53			24.00	0	0	0		
24.25	0	14	14			24.25	0	0	0		
24.50	0	0	0			24.50	0	0	0		
24.75	0	0	0			24.75	0	0	0		
25.00	0	0	0			25.00	0	0	0		

도표 6.3 등급 우유 행사가격 세부 내역

세부 행사가격 (Strike Level Detail) > 현재 만기월을 대상으로 미결제약정, 미결제약정 증감, (행사가격) 거래량을 수치 및 시각화한 차트 형식으로 보여 드립니다. 과거 정보도 이용 가능합니다.

기간 차트 (Historical Charts) > 행사가격 기준 미결제약정과 거래량에 관한 과거 일정기간의 차트를 각 만기월별로 보여 드립니다. 1 개월에서 12 개월까지의 기간 설정이 가능합니다.

거래 예시



도표 7. 콜 및 풋 거래 예시

콜(Calls) > 콜이 들어가는 스프레드 중 많이 쓰이는 사례들을 롱(매수)과 숏(매도)별로 나열합니다. 포지션, 분석 및 민감도 수치 등에 관한 단순한 설명이 있는 손익분기 차트를 볼 수 있습니다.

보기(View) 링크를 클릭하시면 팝업창을 통하여 거래 포지션에 대한 설명과 손익 분석, 포지션에 대한 민감도 수치들의 간략한 설명, 그리고 현재의 선택된 만기월에 대한 실제 행사가를 이용한 손익분기 차트를 표시해 줍니다. 구축(Build) 링크를 클릭하시면 브라우저가 퀵스트라이크 에센셜 트레이드 빌더 페이지로 넘어 가면서 해당 포지션을 표시하며 더욱 자세한 분석 및 조작을 가능하게 해 줍니다.

풋(Puts) > 풋이 들어가는 스프레드 중 많이 쓰이는 사례들을 롱(매수)과 숏(매도)별로 나열합니다. 포지션, 분석 및 민감도 수치 등에 관한 단순한 설명이 있는 손익분기 차트를 볼 수 있습니다.

보기(View) 링크를 클릭하시면 팝업창을 통하여 거래 포지션에 대한 설명과 손익 분석, 포지션에 대한 민감도 수치들의 간략한 설명, 그리고 현재의 선택된 만기월에 대한 실제 행사가를 이용한 손익분기 차트를 표시해 줍니다. 구축(Build) 링크를 클릭하시면 브라우저가 퀵스트라이크 에센셜 트레이드 빌더 페이지로 넘어 가면서 해당 포지션을 표시하며 더욱 자세한 분석 및 조작을 가능하게 해 줍니다.

콜, 풋 종합(Call & Put Combinations) > 콜과 풋의 조합을 이용하는 스프레드 중 많이 쓰이는 사례들을 롱(매수)과 숏(매도)별로 나열합니다. 손익분기 차트를 포지션, 분석 및 민감도 수치들에 대한 간략한 설명과 함께 보여 드립니다. 보기(View) 링크를 클릭하시면 팝업창을 통하여 거래 포지션에 대한 설명과 손익 분석, 포지션에 대한 민감도 수치들의 간략한 설명, 그리고 현재의 선택된 만기월에 대한 실제 행사가를 이용한 손익분기 차트를 표시해 줍니다. 구축(Build) 링크를 클릭하시면 브라우저가 퀵스트라이크 에센셜 트레이드 빌더 페이지로 넘어 가면서 해당 포지션을 표시하며 더욱 자세한 분석 및 조작을 가능하게 해 줍니다.

가격 산정 도구

간편한 옵션계산기(Simple Option Calculator) > 특정 행사가격의 현재의 변동성이나 현재의(또는 어느 시점이든) 옵션가격에서 유도된 내재변동성을 이용하여 가격과 민감도 수치들을 산출하십시오. 선물의 가격, 잔존 일수, 금리 등을 변화시켜 보십시오. 등가격 행사가(각 만기월의)가 하이라이트되어 기본으로 선택되어 있습니다. 옵션 유형 선택은 선택된 행사가가 현재 등가격인지,

외가격 풋인지, 아니면 외가격 콜인지에 따라 다르게 설정되어 있습니다. 좌측의 목록에서 행사가를 클릭하면 계산기가 해당 행사가의 현재가치로부터 시작하게 됩니다. 일단 수치들이 입력된 후에는 가격 산출(Calc Price) 또는 변동성 산출(Calc Vol) 버튼을 누르면 현재 계산조건에 따른 새 가격과 해당 민감도 수치들을 표시하게 됩니다.

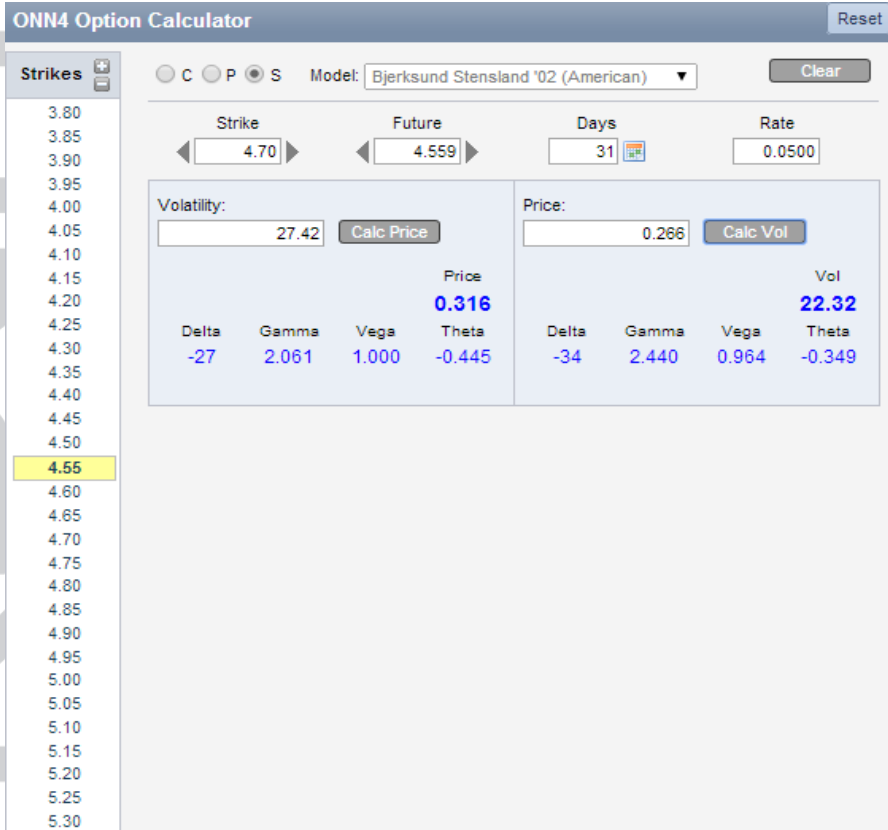


도표 8. 간편한 옵션 계산기

(퀵)스프레드 빌더(Quik Spread Builder) > 어떠한 (만기월물간) 스프레드든지 구축해 보고 손익분기 차트와 민감도 수치들을 확인해 보십시오. 거래 포지션을 단 한 번의 클릭으로 반대로 뒤집어 보십시오. 스프레드를 구축하시려면 단순히 콜 또는 풋 칼럼의 좌측 또는 우측의 텍스트박스 옆의 화살표들을 클릭하십시오. 일단 원하시는 포지션을 입력한 후에는 계산(Calculate) 버튼을 클릭하여 요약표(Data 탭)에서 전반적인 포지션과 전체 민감도 수치들, 현재의 옵션가치 및 스프레드 가치를 선물의 상이한 기간 간격 별로 확인할 수 있으며 최대 및 최소 손익 금액도 확인할 수 있습니다. 차트 탭을 클릭하여 포지션의 손익분기 차트와 전체 민감도 수치들에 대한 미니 차트들을 보실 수 있습니다.

신규(New) 버튼은 포지션을 지우고 +/- 버튼은 거래를 반대 포지션으로 뒤집습니다(매수포지션을 매도포지션으로 매도포지션을 매수포지션으로). 계산(Calculate) 버튼과 같은 줄에 (포지션의 가치가 표시된 후에 표시됨) 헤지(Hedge) 버튼이 있습니다. 이 버튼을 클릭하면 입력된 옵션의 현재의 델타를 상쇄하는 기초자산 선물의 포지션을 추가하여 당신이 단순 포지션과 헤지된 포지션을 버튼 한 번의 클릭으로 확인할 수 있게 해 줍니다. (헤지 버튼을 클릭하게 되면) 지움(Clear) 버튼이 표시됩니다. 이 버튼을 클릭하면 헤지 버튼이 입력한 기초자산 선물 포지션이 제거됩니다.

변동성 도구

변동성 차트(Vol

Charts) > 이 페이지는 현재의 선택된 만기월에 대한 변동성 차트를 표시해 줍니다. 변동성은 가장 최근의 옵션(및 선물) 결제가격으로부터 유도된 내재변동성입니다. 어떠한 행사가든지 선택하여 행사가와 변동성 수치를 확인하십시오.

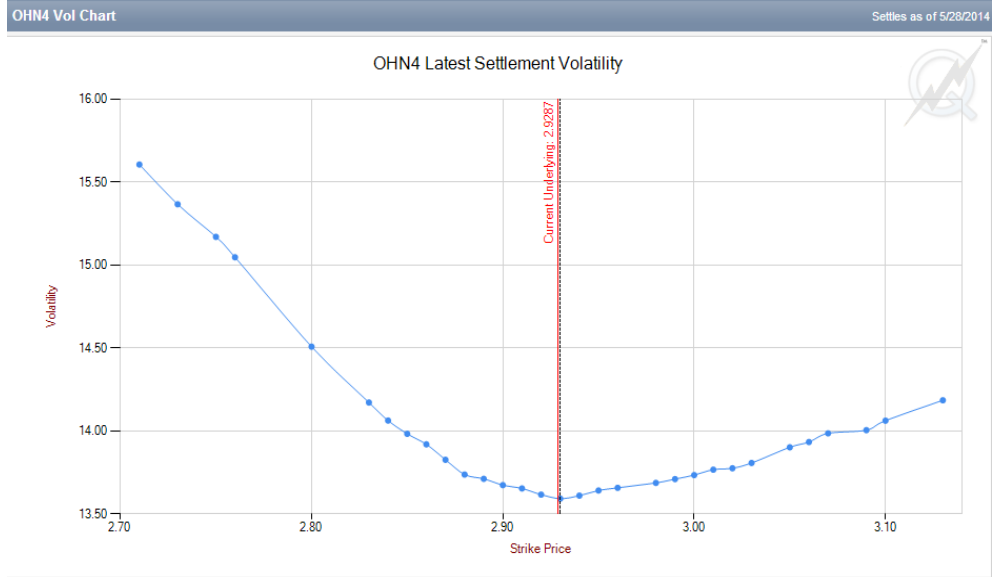


도표 9. 난방유 변동성 차트

복수 만기 변동성 차트(Multi-Expiration Vol Chart >

여러 개의 변동성 곡선들을 단일 차트에 구성하여 비교하여 보십시오. 좌측의 만기 목록 중 어느 박스든지 선택하여 해당 만기들의 현재의 내재변동성 곡선을 표시해 보십시오. (유로달러와 같이) 보다 많은 수의 상품군이나

일부 (옥수수과 같은) 상이한 논리의 옵션 상품군 역시 만기그룹 필터(Expiration Group Filter) 링크가 이 페이지 중앙에 표시됩니다. 이 필터 링크를 클릭하여 어떤 만기그룹을 표시할 것인지 제한하거나 확대할 수 있습니다.

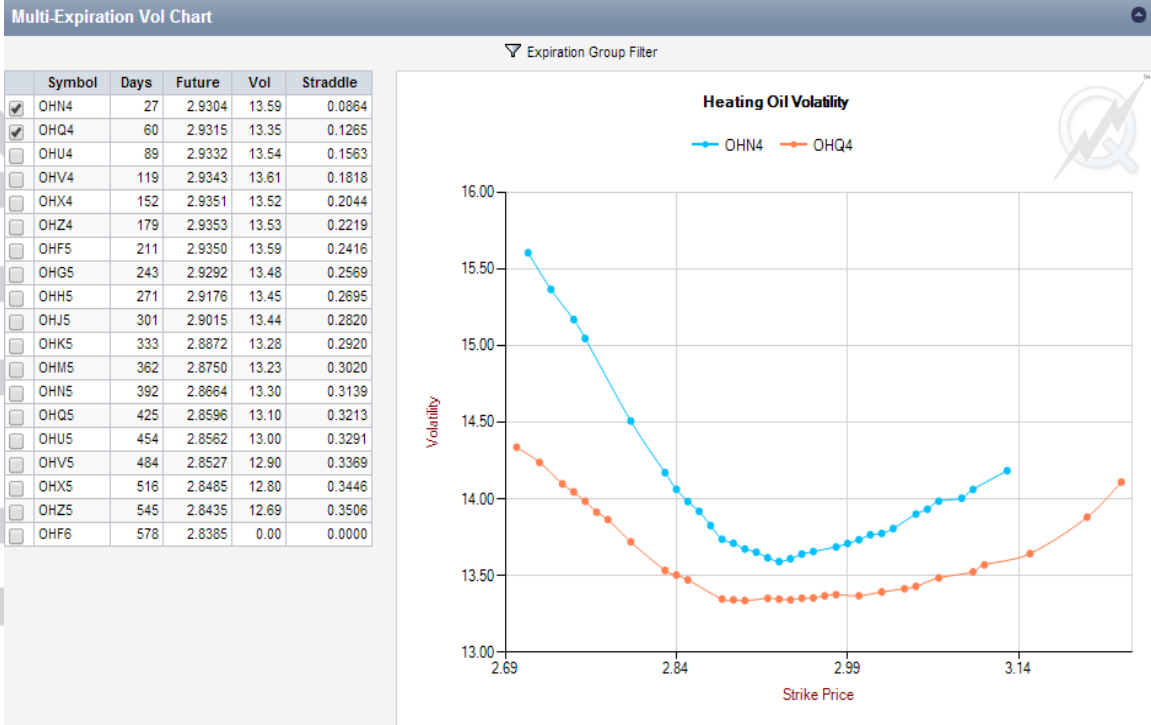


도표 10. 난방유 복수 만기 변동성 차트

유용한 도구 정보

퀵스트라이크 상품 목록을 보시려면 [이 곳을 클릭하세요.](#)

당신만의 퀵스트라이크 에센셜 계정을 [이곳에서](#) 만드십시오.

퀵스트라이크에 대하여 더 자세히 알기 원하시면 [저희 웹사이트](#)를 방문하여 주십시오.

저희 트위터는 [@QuikStrike1](#)입니다.

퀵스트라이크에 관한 [LinkedIn](#) 을 확인해 보십시오. 또 저희의 [이용자 그룹](#)을 확인하여 보십시오.

저희는 동영상 자료를 [YouTube](#) 채널에서 시청하십시오.

면책조항

Copyright © 2004–2013 모든 권리 유보. 이 사이트는 정보제공의 목적으로만 이용됩니다.

웹사이트 이용 조건 : 이 "이용조건"은 당신이 이용하는 quikstrike.net("본 웹사이트")에 적용되는 조건을 규정합니다. 본 웹사이트를 이용함으로써(본 페이지를 처음 읽는 경우를 제외하고) 당신은 여기 규정된 모든 조건을 준수하는 것에 동의하는 것입니다. 본 웹사이트의 이용 권한은 당신의 개인적인 것으로서 다른 어떠한 개인이나 단체에도 양도할 수 없습니다.

저작권 및 상표 : 1. 본 웹사이트 상의 모든 자료는 Copyright 2004-2013, Bantix Technologies, LLC 에 의하여 저작권이 보호됩니다. 모든 권리 유보. 2. 어느 누구도 관련 그래픽 도안을 포함하여 본 웹사이트의 어느 부분도 이용, 복사, 배포가 허용되지 않습니다. 3. 퀵스트라이크와 본 웹사이트에 게재된 다른 등록상표들 및 서비스표(로고 및 디자인을 포함하여)들은 QuikStrike 및 Bantix Technologies, LLC 의 제품이나 서비스들의 정체성을 구성하는 등록상표/서비스상표입니다.

이 상표들은 어떠한 경우에도 Bantix Technologies, LLC 의 사전 서면 승인 없이는 이용될 수 없습니다.

4. CME 및 CME Group 은 Chicago Mercantile Exchange Inc.의 등록상표로서 승인 하에 이용되었습니다. 본 웹사이트의 내용은 Chicago Mercantile Exchange Inc.의 후원이나 보장, 판매, 홍보 대상이 아닙니다. 또한 Chicago Mercantile Exchange Inc.는 여기에 포함된 내용에 대한 아무런 책임도 지지 않습니다.

제 3 자 웹사이트에의 링크 : Bantix Technologies, LLC 는 본 웹사이트 이용자의 편의를 위하여 제 3 자 웹사이트에의 하이퍼링크를 제공할 수 있습니다. Bantix Technologies, LLC 는 제 3 자 웹사이트들을 관리하지 않으며 그러한 링크된 어떠한 제 3 자 웹사이트나 하이퍼링크된 웹사이트에 대하여도 아무런 책임도 지지 않습니다. Bantix Technologies, LLC 는 본 웹사이트에서 링크한 어떠한 제 3 자 웹사이트에 대하여도 보장이나 권고, 승인을 하지 않습니다. Bantix Technologies, LLC 는 그러한 하이퍼링크를 통하여 이용 가능한 내용이나 그 내용의 이용에 대하여 아무에게도 어떠한 책임도 지지 않습니다.

CME 그룹은 본 사이트의 이용에 따른 어떠한 이익이나 손실에 대하여도 책임지지 않습니다. 결제 가격 및 지연 데이터 Bantix Technologies, LLC 의 QuikStrike™ v2.0 을 기반으로 한 eSignal.을 통하여 제공.