

주가지수 파생상품 - EURO STOXX 50® 지수선물 (FESX)

EURO STOXX 50® 지수 파생상품은 주식 포트폴리오의 성과를 향상시키거나 헤징을 하는 데에 매우 적합하다. 또한, EURO STOXX 50® 지수선물은 단일 계약이 전체 마켓 세그먼트를 망라하기 때문에 차익거래 전략에서도 광범위하게 사용되고 있다.

EURO STOXX 50® 지수의 선물과 옵션은 유로화 주식 지수 파생상품 중 가장 활발하게 거래되는 상품들이다. 2016년 상반기에만 2억 1500만 이상의 규모의 EURO STOXX 50® 지수선물이 거래되었으며, 일일 평균 160만 이상의 계약거래를 기록하였다. 지난 6월 말 미결제약정 (Open Interest) 은 약 410만 건이었다.

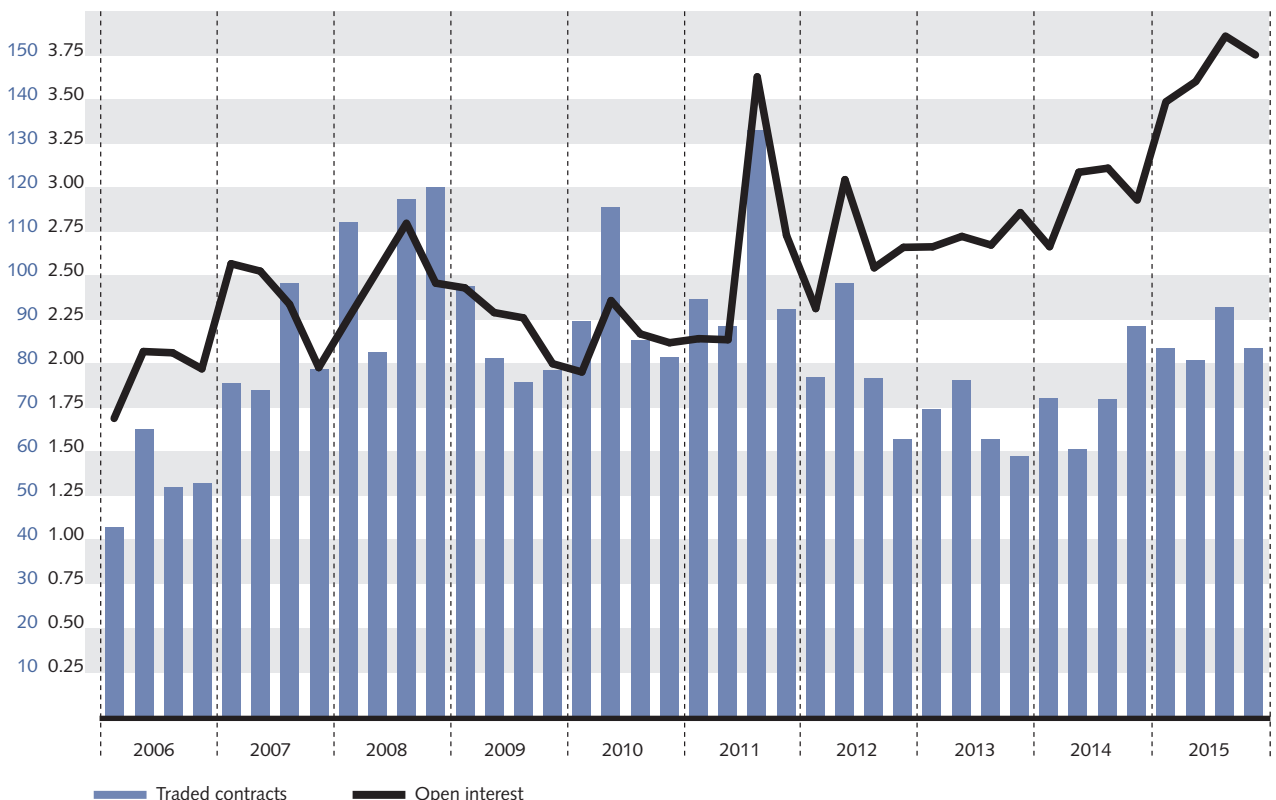
투자자는 선물계약(Futures Contracts)과 더불어 EURO STOXX 50® 지수의 옵션 또한 거래할 수 있다. EURO STOXX 50® 리스트에 속한 모든 50개 종목이 그 대상이며, Eurex의 '개별주식선물' (Single Stock Futures)과 주식옵션의 사용을 통해 투자자는 한층 더 집중화된 트레이딩 전략을 구사할 수 있다.

그렇기에 Eurex Exchange는 유로존 주식과 주가지수 파생상품의 선도적인 플랫폼이라 할 수 있다.

지수의 구성 및 산출방식

EURO STOXX 50® 지수는 12개 유로존 국가에 상장된 50개 주요 블루칩 종목으로 구성되어 있다. 지수 가중치는 주가 유동주식수 기준 시가총액 방식(Free Float Market Capitalization)을 기준으로 하며, 이중 한 종목이 전체 인덱스에서 차지하는 비중은 최대 10%이다. EURO STOXX 50® 지수의 유동주식수 기준 시가총액은 유로존 전체 시가총액의 60%가량을 차지하고 있다.

2006년 1월 - 2015년 12월 간 계약 거래량 및 미결제약정 (단위: 1백만)



EURO STOXX® 지수는 매 15초 간격으로 산정 발표된다. 인덱스 구성은 매년 재검토되며, 이에 따른 조정 사항은 9월부터 적용된다. 인덱스 구성 개별종목의 가중치는 분기마다 재검토된다.

현재, Eurex는 EURO STOXX® 지수군 내 49개의 인덱스 파생상품을 제공하고 있다. Eurex 파생상품의 기초상품 인덱스 구성과 관련된 더욱 자세한 정보는 STOXX® 홈페이지 www.stoxx.com에서 확인 가능하다.

계약과 관련한 세부사항

EURO STOXX 50® 지수선물은 1인덱스당 10유로의 계약가치 (Contracts Value)를 지닌다. 최저 가격 변동(또는 호가가격 단위)은 1인덱스 포인트와 동일하며, 이는 10유로의 틱 가치 (Tick Value)에 해당한다. 분기별로 각각 3월, 6월, 9월, 12월 이내에 연속된 3개월 동안 언제든지 거래가 가능하다. 최종거래일은 각 만기 월의 셋째 주 금요일*이다. EURO STOXX 50® 지수선물의 거래 시간은 중앙유럽 표준시 (CET)기준 오전

7시 50분부터 오후 22시까지이며, 최종거래일에는 오후 12시에 거래가 마감된다.

유동성

대개 전월 계약의 최고 입찰가와 호가 간의 스프레드는 1틱에 불과하며, 이것은 EURO STOXX 50® 지수선물이 투자자에게 풍부한 유동성을 제공함을 의미한다.

추가정보

거래/헤징을 위한 EURO STOXX 50® 지수선물 계약 이용방법과 관련된 더욱 자세한 정보는 Eurex 홈페이지 www.eurexchange.asia에서 확인할 수 있다.

* If the third Friday is not an exchange day, the Last Trading Day is the exchange day preceding the third Friday.

Sales Contacts

Sales Korea & Japan

Stefan Morgenstern T +852 25 30-78 08
Stefan.Morgenstern@eurexchange.com

Takeaki Murakami T +81-3 45 78-66 22
Takeaki.Murakami@eurexchange.com

Sales Hong Kong

Markus Georgi T +852 25 30-78 21
Markus.Georgi@eurexchange.com

Sales Singapore

Peter Fricke T +65-65 97-30 62
Peter.Fricke@eurexchange.com

Order Number: E1K-137-0716

ARBN Number: Eurex Frankfurt AG ARBN 100 999 764

Neither Eurex Frankfurt AG (Eurex), nor its servants nor agents, is responsible for any errors or omissions contained in this publication which is published for information only and shall not constitute an investment advice. Any information herein is not intended for solicitation purposes but only for the use of general information. Eurex offers services directly to members of the Eurex market. Those wishing to trade in any products available on the Eurex market or to offer and sell any such products to others should consider both their legal and regulatory position in the relevant jurisdiction and the risks associated with such products before doing so.

The STOXX® indexes, the data included therein and the trademarks used in the index names are the intellectual property of STOXX Limited and/or its licensors. Eurex derivatives based on the STOXX® indexes are in no way sponsored, endorsed, sold or promoted by STOXX and its licensors and neither STOXX nor its licensors shall have any liability with respect thereto.