

如何对股票组合进行套期保值：怎样利用股指期货进行套期保值？-股识吧

一、如何操作套期保值

中图分类号：S776文献标识码：A 文章编号：套期保值在实际工作中的运用是非常复杂的，而且是高风险，需要具备专业的理论知识，正确操作可以为企业规避风险、锁定成本、锁定价格、锁定利润，操作不当适得其反。

(剩余2040字)

二、权证和股票要怎么操作才能实现套期保值

如何发挥权证的套期保值和风险治理的功能与作用? 答：通常情况下，投资者在拥有某股票的情况下，会购买相应股票的认沽权证，以对冲该股票价格下跌所带来的损失；

而卖空股票时，则会购买相应股票的认购权证，用以规避该股票价格上升给投资者所造成的损失。

由于我国内地尚不具有卖空机制，所以，不会有卖空股票的现象出现，这是不是认购权证就派不上用处了呢?也不是这样的，不具有某股票的投资者，假如购买该股票的认购权证，就可以起到比直接购买该股票还要好的效果，因为，购买该认购权证收益不封顶、损失却可以保底。

概括地讲，从控制风险的角度讲，拥有某股票的投资者，可以购买该股票的认沽权证规避风险，切不可去购买该股票的认购权证，否则的话，会适得其反，增加风险。

当然，投资者要购买认购权证的话，最好去购买手上没有该股票的认购权证进行避险。

除与标的资产组成套期保值组合外，在日常的投资组合治理中，也可以充分发挥权证的作用，以进一步分散组合风险。

在投资组合治理中，权证比起股票具有两个优点：其一是投资成本小，使得原本无力进行的分散投资成为可能；

其二是权证有认购、认沽之分，其系统风险截然相反，为投资组合提供了更加灵活的选择机会。

不过，我们一般建议投资者只将组合中10%左右的资金放在权证上，因为权证具有杠杆效应，投资过大会将风险过度放大。

投资者应该按照自己的风险承受能力确定投资在权证上的资金。

知道了该如何利用权证进行投资后，我们还应该明白，市场上交易的权证定价是否合理。

三、卖出股指期货套期保值怎么操作

买入标的股票，换算成具体金额。
然后卖出股指期货，对应换算金额。
当然会有点基差。
这个自己考虑下偏正还是偏负。

四、股票股指套期保值是什么啊

例如，你有100亿中信证券的股，你看空他，所以你想卖他。
但是你手上的货实在是太多了，所以你一抛的话，股价就会跌得很厉害，就卖不到好价钱。
这时候，你就可以卖出与你那100亿中信证券等效的股票期货或者股指期货，那么你就可以在中信下跌时，你亏去的部分在期指上赚回来。
这就是套期保值了。

五、如何套期保值??

如何发挥权证的套期保值和风险治理的功能与作用? 答：通常情况下，投资者在拥有某股票的情况下，会购买相应股票的认沽权证，以对冲该股票价格下跌所带来的损失；

而卖空股票时，则会购买相应股票的认购权证，用以规避该股票价格上升给投资者所造成的损失。

由于我国内地尚不具有卖空机制，所以，不会有卖空股票的现象出现，这是不是认购权证就派不上用处了呢?也不是这样的，不具有某股票的投资者，假如购买该股票的认购权证，就可以起到比直接购买该股票还要好的效果，因为，购买该认购权证收益不封顶、损失却可以保底。

概括地讲，从控制风险的角度讲，拥有某股票的投资者，可以购买该股票的认沽权证规避风险，切不可去购买该股票的认购权证，否则的话，会适得其反，增加风险。

当然，投资者要购买认购权证的话，最好去购买手上没有该股票的认购权证进行避险。

除与标的资产组成套期保值组合外，在日常的投资组合治理中，也可以充分发挥权证的作用，以进一步分散组合风险。

在投资组合治理中，权证比起股票具有两个优点：其一是投资成本小，使得原本无力进行的分散投资成为可能；

其二是权证有认购、认沽之分，其系统风险截然相反，为投资组合提供了更加灵活的选择机会。

不过，我们一般建议投资者只将组合中10%左右的资金放在权证上，因为权证具有杠杆效应，投资过大会将风险过度放大。

投资者应该按照自己的风险承受能力确定投资在权证上的资金。

知道了该如何利用权证进行投资后，我们还应该明白，市场上交易的权证定价是否合理。

六、套期保值?如何做?假如我对现拥有的股票很满意！有几种方法来保值?哪种方比较好?为什么?

国内的交易机制还没有成熟 ;

个股是不能做套期保值的。

股指期货才可以做套期保值，或者是商品期货比如黄金。

七、套期保值的基本做法是？

1)套期保值的含义 所谓套期保值，是指交易者为了配合现货市场的交易，而在期货市场上设立与现货市场方向相反的交易部位(或头寸)，以便达到转移、规避价格风险的交易行为。

具体地说，就是在期货市场上头进(或卖出)与其将在现货市场买进(或卖出)的现货商品数量相同的该商品的期货合约，以期在未来某一时间在现货市场上买进(或卖出)现货商品时，在期货市场上卖出(或买进)原来所买进的全部该商品的期货合约。

。

(2)套期保值的操作 进行有效的套期保值，必须遵循操作上的四大原则：

交易方向相对原则。

也称作“反向操作的原则”，即在两个市场上同时或先后采取相反的买卖行动，建立起一种互相补偿的机制。

具体地说，在现货市场上买进(或卖出)的同时或前后，在期货市场上卖出(或买进)该种商品的期货合约，这样套期保值才能取得在一个市场上亏损的同时在另一个市场上必定会盈利的结果，两者相抵，才能达到保值目的。

商品种类相同或相关原则。

套期保值所选择的期货品种必须与现货市场上买卖的商品是相同种类。

当然，在期货交易的实践中，也有一种叫作“交叉套期保值交易”的做法，即选择一种与该现货商品种类不同，但在价格走势上互相影响且大致相关的相关商品的期货合约，这种替代的期货商品最好也是现货商品的替代商品，替代性越强，套期保值的效果越好。

商品数量相等的原则。

是指在做套期保值时，选择的期货合约的数量要与交易者在现货市场上买进或者卖出的实际数量相等，只有这样才能达到保值的效果。

月份相同或相近原则。

是指套期保值时，所选用的期货合约的交割月份最好与交易者将来在现货市场上实际买进或卖出的现货商品的时间相同或相近，这样才能达到到交割月份进行对冲，完成套期保值交易。

(3)套期保值的功能 套期保值是一种有意识的防御性措施，是通过现货市场与期货市场的反方向运作，形成现货与期货一盈一亏的结果，经过盈亏相抵，达到减少或规避价格风险的目的。

其功能表现在以下几个方面： 稳定社会生产成本。

由于可进行套期保值，企业可以根据既定的成本开支来安排生产经营，稳定其生产经营活动，进而达到对社会成本的稳定作用。

促进形成合理的价格水平。

套期保值行为本身具有一种平抑商品价格的作用，这是期货“发现价格”功能的一个重要方面。

当市场价格偏低时，保值者便会在期货市场上竞相购入合约，使价格回升；

当市场价格偏高时，保值者会纷纷卖出合约，使价格回落，这样就可以促使该商品价格趋于稳定，从而形成合理的价格水平。

为企业防范价格波动提供了有力手段。

企业可以根据自己对商品价格变化趋势的判断，选择自己在期货市场上的买卖方向，进而消除因商品价格的波动产生的不利影响。

促进产品销售，减少企业存货积压的困境，并节俭大量的仓储费用。

八、如何套期保值??

套期保值者是指那些把期货市场作为价格风险转移的场所，利用期货合约作为将来在现货市场上进行买卖商品的临时替代物，对其现在买进（或者拥有，或将来拥有）准备以后售出或将来需要买进商品的价格进行保值的厂商、机构和个人。

套期保值的原理

套期保值之所以能够规避风险，是因为期货市场上存在以下基本经济原理：

（一）同种商品的期货价格走势与现货价格走势一致。

（二）现货市场与期货市场价格随期货合约到期日的临近、两者趋向一致。

套期保值的操作原理 （一）商品种类相同原则

（二）商品数量相同原则 （三）月份相同或相近原则

（四）交易方向相反原则 套期保值的应用 生产经营企业面临的价格

波动风险最终可分为两种：一种是担心未来某种商品的价格上涨；

另外一种是担心未来某种商品的价格下跌。

买入套期保值 买入套期保值就是指套期保值者先在期货市场上买入与其将在现货市场上买入的现货商品数量相等、交割日期相同或相近的该商品期货合约，及预先在期货市场上买空，持有多头头寸。

适用对象及范围 1、加工制造企业为了防止日后购进原料是价格上涨的情况。

2、供货商已经跟需求方签订好现货合同，将来交货，但供货方此时尚未购进货源，担心日后购进货源时价格上涨。

3、需求方认为目前现货市场的价格很合适，但由于资金不足或者缺少外汇或一时找不到符合规格的商品，或者仓库已满，不能立即买进现货，担心日后购进现货价格上涨。

卖出套期保值 卖出套期保值是指套期保值者先在期货市场上卖出与其将在现货市场上卖出的现货商品数量相等，交割日期也相同或相近的该商品期货合约

适用对象及范围： 1、直接生产商品期货实物的生产厂家、农场、工厂的手头有库存产品尚未销售或即将生产、收获某种商品实物期货，担心日后出售时价格下跌；

2、储运商、贸易商手头有库存现货未出售或储运商、贸易商已签订将来以特定价格买进某一商品但未转售出去，担心日后出售时价格下跌；

3、加工制造企业担心日后库存原料价格下跌。

在首次执行日，对于不符合《企业会计准则第24号——套期保值》规定的套期会计方法运用条件的套期保值，应当终止采用原套期会计方法，并按照《企业会计准则第24号——套期保值》处理。

参考文档

[下载：如何对股票组合进行套期保值.pdf](#)

[《股票拿出钱要多久》](#)

[《股票手机开户一般要多久给账号》](#)

[《股票发债时间多久》](#)

[下载：如何对股票组合进行套期保值.doc](#)

[更多关于《如何对股票组合进行套期保值》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/article/34314433.html>