

如何进行股指期货套利，怎样才能能在股指期货套利中取得成功-股识吧

一、期货套利的具体操作

套利，打个比方，今天2022.3.24cf1009午盘收盘价格是17170，而cf1103午盘收盘价是16770，差价达到400，我们可以判断往后行情必定缩短差价，所以可以采用做空CF1009，做多CF1103所以不必管这两个合约处于上升还是下跌趋势，只要价格能缩小，你就能盈利不过盘面看来，1009明显弱于1103，所以大可放心套利至于现货来说，期货是预期价格而不是现在的价格，所以以后价格怎样也很难说，现货的价格参考价值不大，研究现货价格相当于研究以前的K线走势打了这么多字才发现悬赏分是0，~~~~~

二、现在股指期货套利都有哪些常用手段

股指期货套利是期货套利交易的一种类型，其原理是在市场价格关系处于不正常状态下进行双边交易以获取低风险差价。

股指期货套利类型有：1、期现套利（当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个市场的价格差距，低买高卖而获利。

）2、跨期套利（在同一期货品种的不同合约月份建立数量相等、方向相反的交易部位，并以对冲或交割方式结束交易的一种操作方式。

）3、跨市套利（利用同一商品在不同交易所的期货价格的不同，在两个交易所同时买进和卖出期货合约以谋取利润的活动。

）4、跨品种套利（通过对两个乃至两个以上品种之间价值差异来捕捉投资机会）。

三、如何实现股指期货期现套利

期现套利是指某种期货合约，当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个市场的价格差距，低买高卖而获利。

理论上，期货价格是商品未来的价格，现货价格是商品目前的价格，按照经济学上的同一价格理论，两者间的差距，即"基差"(基差=现货价格-

期货价格)应该等于该商品的持有成本。

一旦基差与持有成本偏离较大，就出现了期现套利的机会。

其中，期货价格要高出现货价格，并且超过用于交割的各项成本，如运输成本、质检成本、仓储成本、开具发票所增加的成本等等。

期现套利主要包括正向买进期现套利和反向买进期现套利两种。

期现套利对于股指期货市场非常重要。

一方面，正因为股指期货和股票市场之间可以套利，股指期货的价格才不会脱离股票指数的现货价格而出现离谱的价格。

期现套利使股指价格更合理，更能反映股票市场的走势。

另一方面，套利行为有助于股指期货市场流动性的提高。

套利行为的存在不仅增加了股指期货市场的交易量，也增加了股票市场的交易量。

市场流动性的提高，有利于投资者交易和套期保值操作的顺利进行。

四、股指期货套利方面的。

股指期货套利一个是期货价格和现货价格(沪深300指数)价格差大了就可以做反向操作来赚钱。

比如沪深300指数2700点IF005是3000，价差超出10%了就出现100%套利机会，这时候可以买IF005跌赚钱。

IF005肯定跌，因为到5。

21号期货和现货点数是基本一样的。

第2个是期货品种相关之间的套利，就是

IF005和IF006之间价格差大了也可以买卖这2个反向操作赚钱。

到5。

21号必须交割！股指期货交割结算价为最后交易日标的指数的最后2小时算术平均价。

届时，持有者必须平仓、套期保值者需要移仓（移到IF006）不交割的交易所会自动平仓 IF005和IF006都和沪深300指数有连系，期货的价格都和现货指数相关，到期也一样。

股指期货现在是个人在参与，没有基金、证券、保险等企业在交易。

但是已经批准基金、证券来交易，下周他们就可以进场了

五、怎样才能能在股指期货套利中取得成功

套利交易的风险有限，收益稳定，所以，一直受到了投资者特别是机构投资者的欢迎。

期现套利指的是当期货市场和现货市场在价格上出现不合理价差的时候，交易者可以利用两个市场进行买卖，缩小现货市场和期货市场之间的价差，获取收益。

那怎样才能在这股指期现的套利中取得成功呢?专家们认为有三点要素是比不可少的，也就是把握住这三个时机，投资者就可以在股指期现套利中获得可观的收益。

一：股指期货的推出初期 股指期货在推出初期，因为市场效率比较低，所以期货更容易偏离现货，等到运行一段时间之后，投资者的理念就更加的趋向理性化，套利的机会就会大幅的下降。

也就是说，在股指期货推出的初期，期现套利的收益空间很大，随着市场的发展与成熟，期现套利的收益空间快速缩小。

二：大市值的权重公司发生特殊事件的时候 当指数中的某大市值权重股发生重大利空的事件，处于停牌期的时候，投资者可以通过卖空期货，买入除了此大市值权重股之外的指数成分股现货。

等到该大市值的权重股复牌，股价下跌带动了股指期货的下跌，平仓了结，完成套利。

当指数成分股中的大市值权重股因重大利好事件停牌的时候，因无法购买股票现货，可以考虑通过指数期货和股票现货的组合模拟买入现货，投资者可以通过买入期货，同时卖出除了此大市值权重股之外的指数成分股现货。

待此大市值权重股复牌，股价上涨推动股指期货上涨后，平仓了结，完成套利。

三：指数成分股的分红期 当投资者的一致预期比实际分红低的时候，股指期货就会很容易被高估，产生正套利机会。

当投资者的一致预期高于实际分红时，股指期货容易被低估，则产生反向套利机会。

以上就是和大家介绍的股指期现套利成功的三要素，希望投资股指期货的投资者能够对这三个时机，灵活的把握住，在股指期现套利中取得成功。

参考文档

[下载：如何进行股指期货套利.pdf](#)

[《比亚迪股票多久到700》](#)

[《只要钱多久能让股票不下跌吗》](#)

[《股票涨幅过大停牌核查一般要多久》](#)

[《小盘股票中签后多久上市》](#)

[《股票卖完后钱多久能转》](#)

[下载：如何进行股指期货套利.doc](#)

[更多关于《如何进行股指期货套利》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/34423420.html>