

## 沪深300股票指数对冲是怎么回事~贝塔对冲是什么意思？ -股识吧

### 一、做对冲是什么意思，买进强势，出售弱势？请举一个具体例子，让我好好的理解下

这个很好理解，贝塔值 是 个股与指数 的走势进行对比的值（贝塔值采用回归法计算，将整个市场波动带来的风险确定为1。

当某项资产的价格波动与整个市场波动一致时，其贝塔值也等于1；

如果价格波动幅度大于整个市场，其贝塔值则大于1；

如果价格波动小于市场波动，其贝塔值便小于1。

）。

在买一揽子股票后，将买的股票和沪深300指数做个贝塔值的对比，然后用加权平均的方式计算出用多少股指期货来做对冲，股指的市值和股票的市值几乎是等量的

。

名字很专业，事实上国内的股票和股指对冲类的基金都是用的这个原理，只是销售时很少用这个词的，因为很多人根本听不懂专业名词。

希望能帮到你。

### 二、沪深300指数是什么意思

沪深300指数股是从深市挑选了108只,从沪市挑选192只有代表性的股票作为沪深300指标股,其中大部分为大盘蓝筹股.沪深300指标股的走势决定大盘的走势

### 三、贝塔对冲是什么意思？

这个很好理解，贝塔值 是 个股与指数 的走势进行对比的值（贝塔值采用回归法计算，将整个市场波动带来的风险确定为1。

当某项资产的价格波动与整个市场波动一致时，其贝塔值也等于1；

如果价格波动幅度大于整个市场，其贝塔值则大于1；

如果价格波动小于市场波动，其贝塔值便小于1。

）。

在买一揽子股票后，将买的股票和沪深300指数做个贝塔值的对比，然后用加权平均的方式计算出用多少股指期货来做对冲，股指的市值和股票的市值几乎是等量的。

名字很专业，事实上国内的股票和股指对冲类的基金都是用的这个原理，只是销售时很少用这个词的，因为很多人根本听不懂专业名词。希望能帮到你。

## 四、股票与股指对冲例题，在线等

期指这块的收益为： $(1670-1503) * 200 * 10 = 334000$

股票这块的收益为： $(1485-1650) / 1650 * 500万 = -500000$  所以总的收益为  
 $334000 - 500000 = -166000$

## 五、一张股指期货合约应该买多少钱的股票才能对冲风险?

其实不用想的太复杂，按一张合约的总价值来买就行了（不是保证金数额），要对冲风险自然要买股指期货的标的物即沪深300指数，两种方法：一、去购买等同一张合约总价值的沪深300指数基金（按2022年12月12日收盘价计算，一张合约总价值是 $2266 * 300 = 679,800$ 元）。

二、自然是直接去买股票了，300个权重股你平均买吧， $679800 / 300 = 2266$ 元。不是巨额资金肯定是买300指数基金方便了。

## 参考文档

[下载：沪深300股票指数对冲是怎么回事.pdf](#)

[《股票被炒过要多久才能再炒》](#)

[《买了8万的股票持有多久可打新》](#)

[《股票停牌多久下市》](#)

[下载：沪深300股票指数对冲是怎么回事.doc](#)

[更多关于《沪深300股票指数对冲是怎么回事》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/book/12201691.html>