

国内股票怎么对冲--什么是A股和H股的价差？怎样对冲？ -股识吧

一、如何用股指期货进行对冲交易

所谓对冲交易，举个例子吧，你马上就会明白，比如我手上持有价值50w的股票，我害怕价格下跌，那么我就在期货市场做空价值50w左右的期货合约（注意：期货合约的价格根据当时的点位计算，所以有可能需要花50w还要多的价钱去买），总之假如股票跌了。

那么股票是亏钱了，那么股指期货那边空单赚钱了，这样可以大大降低损失，或者抵消损失，甚至得到些许利润。

懂了么？相反，如果你是50w以上的大户并且在券商开了融资融券账户，你在你觉得是头部的位置融券做空了，但是你害怕股价继续涨造成亏损，你就在期货市场做多差不多等值的期货合约，这样即使你融券做空之后股价涨了，你期货合约多单能赚钱。

这种交易一般用在跟指数比较联动的二线蓝筹股...我个人只做股指期货，因为我是券商的分析师，合规不允许我做股票。

我也不爱做股票，我太清楚a股是什么混账东西了。

中国的a股市场还很不规范，在中国投资a股不算投资，跟国外不一样。

你如果喜欢做我建议你做期指，期指没有那么可怕。

而且期指来钱也快，适合我这种急性子，日内交易也比较好控制风险。

我就以现在的点位说，现在一手股指大概10w多一点，波动一个点是300，你一天至少要亏损20个点加上手续费，你可能才能亏个7000左右。

但是如果你是买股票，我记得最清楚的就是10月25日那天钢铁股早盘势头很猛，好几股直冲涨停板，我单位同事用自己亲戚账户做股票的很多都跟进去，结果涨停没封住多久直接跳水，第二天又低开，直接损失大几千甚至几万。

而且日内交易你止损会很快，股票有的人一旦被套住，有的都去掉百分五六十了，还不舍得走。

所以，作为业内人士，我推荐你，珍爱财富，远离a股。

但是也不是说股指就好做。

你如果要做，我劝你做个三个月到半年的模拟盘，这样你可以再之后实盘少犯很多低级和致命的错误，等到你用模拟盘可以做到大部分时间都是盈利的时候，你就可以去做实盘了，如果一手太贵你做不起，你可以去投资公司配资做，我就是配资做的，15000配一手，200日息，不管你交易几次，手续费万分0.3，每手未盈利之前只允许亏损6000，也就是20个点。

配资公司一定要找口碑好的，日息低的，在当地已经做了一段时间的投资公司。

祝你好运....

二、股票如何对冲交易？

对冲交易即同时进行两笔行情相关、方向相反、数量相当、盈亏相抵的交易。行情相关是指影响两种商品价格行情的市场供求关系存在同一性，供求关系若发生变化，同时会影响两种商品的价格，且价格变化的方向大体一致。

方向相反指两笔交易的买卖方向相反，这样无论价格向什么方向变化，总是一盈一亏。

当然要做到盈亏相抵，两笔交易的数量大小须根据各自价格变动的幅度来确定，大体做到数量相当。

可以做“对冲”的交易有很多种，外汇对冲，期权对冲，但最适宜的还是期货交易。

首先是因为期货交易采用保证金制度，同样规模的交易，只需投入较少的资金，这样同时做两笔交易成本增加不多。

其次是期货可以买空卖空，合约平仓的虚盘对冲和实物交割的实盘对冲都可以做，完成交易的条件比较灵活，所以对冲交易也是在期货这种金融衍生工具诞生以后才得以较快发展。

三、中国股票可以进行T+0双向涨跌买卖吗？

您指的股票即时买卖，双向交易操作在国际上统一为“CFD量化对冲交易”股票T+0双向交易在全世界各国是普遍的操作方式，如美股，日本股市，英法巴并且也包括中国香港股市都是T+0操作。

其实大A在很早以前就可以这样T+0双向交易操作，这种操作有一个命名为‘融资融券’，但是券商开通条件比较苛刻：1.股市本金长期保持在50万以上，股龄8年以上。

2.各方面信用良好，银行目前有贷款为还清者不予以开通。

因为我们国家人口较多，如果股市开放了做空会对金融市场产生较大的风险，许多国外投机者会盯准我国市场做空，

从而扰乱我们股市秩序，所以只有小部分了解并且有资格的股民可以操作。

另外如果达不到要求的股民想进行T+0操作也可以选择CFD量化国际对冲基金平台操作，小散户也可以操作。

现在国内这种平台有不少，希望我的回答对您有所帮助。

四、如何对一只股票做空

先找到可以融券标的股，首先融券卖出，然后买券还券，举例：例如你看上一个股票现在10元的，你可以融券卖出100股，意思是现在你是借了别人100股，卖出去给别人，等这个股票价格下去到假如是8元，你以8元每股的价格买回100股还给别人，这样你就有了2元每股的价差，做空就是这样做的。

扩展资料：做空，是一个投资术语，是金融资产的一种操作模式。

与做多相对，做空是先借入标的资产，然后卖出获得现金，过一段时间之后，再支出现金买入标的资产归还。

做空的常见作用有投机、融资和对冲。

其中用做空投机是指预期未来行情下跌，则卖高买低，将手中借入的股票按目前价格卖出，待行情跌后买进再归还，获取差价利润。

其交易行为特点为先卖后买。

实际上有点像商业中的赊货交易模式。

这种模式在价格下跌的波段中能够获利，就是先在高位借货进来卖出，等跌了之后再买进归还。

参考资料：百科-做空

五、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。

六、中国股票可以进行T+0双向涨跌买卖吗？

您指的股票即时买卖，双向交易操作在国际上统一为“CFD量化对冲交易”股票T+0双向交易在全世界各国是普遍的操作方式，如美股，日本股市，英法巴并且也包括中国香港股市都是T+0操作。

其实大A在很早以前就可以这样T+0双向交易操作，这种操作有一个命名为‘融资融券’，但是券商开通条件比较苛刻：1.股市本金长期保持在50万以上，股龄8年以上。

2.各方面信用良好，银行目前有贷款为还清者不予以开通。

因为我们国家人口较多，如果股市开放了做空会对金融市场产生较大的风险，许多国外投机者会盯准我国市场做空，

从而扰乱我们股市秩序，所以只有小部分了解并且有资格的股民可以操作。

另外如果达不到要求的股民想进行T+0操作也可以选择CFD量化国际对冲基金平台操作，小散户也可以操作。

现在国内这种平台有不少，希望我的回答对您有所帮助。

七、请各位帮俺下，解释下对冲了。谢谢！！！！

就是做多一个行业时，也买他跌，中国市场还不支持做空机制，前年有估权时可以，就是买他的正股，可以也买他的估权，如果涨了他可以赚钱，跌了权证的上涨会弥补下股票下跌的损失。

八、什么是A股和H股的价差？怎样对冲？

主要原因如下：1.结算货币不同 A股用人民币结算 H股用港币结算

2.投资者构成不同A股主要面向国内投资者 H股面向全球各类投资者

3.股份流通性不同 A股虽然已经完成全流通改革 但是大部分股份仍然在限售期内 港股为全流通 无法对冲

九、对冲基金投机人民币的手法和途径

最初的对冲操作中，基金管理者在购入一种股票、货币、期货合约后，同时购入这种股票、货币、期货合约的一定价位和时效的看跌期权（Put Option）。

看跌期权的效用在于当股票价位跌破期权限定的价格时，卖方期权的持有者可将手中持有的股票、货币、期货合约以期权限定的价格卖出，从而使股票、货币、期货合约跌价的风险得到对冲。

正因为如此的操作手段，早期的对冲基金才被用于避险保值的保守投资策略的基金管理形式。

可是，随着时间的推移，人们对金融衍生工具的作用的理解逐渐深入，近年来对冲基金倍受青睐是由于对冲基金有能力在熊市赚钱。

从1999年到2002年，普通公共基金平均每年损失11.7%，而对冲基金在同一期间每年赢利11.2%。

对冲基金实现如此骄人的成绩是有原因的，而且它们所获得的收益并不像外界所理解的那么容易，几乎所有对冲基金的管理者都是出色的金融经纪。

被对冲基金所利用的金融衍生工具（以期权为例）有三大特点：第一，它可以以较少的资金撬动一笔较大的交易，人们把其称为对冲基金的放大作用，一般为20至100倍；

当这笔交易足够大时，就可以影响价格；

第二，根据洛伦兹·格利茨的观点，由于期权合约的买者只有权利而没有义务，即在交割日时，如果该期权的执行价格（Strikeprice）不利于期权持有者，该持有者可以不履行它。

这种安排降低了期权购买者的风险，同时又诱使人们进行更为冒险的投资（即投机）；

第三，根据约翰·赫尔的观点，期权的执行价格越是偏离期权的标的资产（特定标的物）的现货价格，其本身的价格越低，这给对冲基金后来的投机活动带来便利。

对冲基金管理者发现金融衍生工具的上述特点后，他们所掌握的对冲基金便开始改变了投资策略，他们把套期交易的投资策略变为通过大量交易操纵相关的几个金融市场，从它们的价格变动中获利。

参考文档

[下载：国内股票怎么对冲.pdf](#)

[《股票改手续费要多久》](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：国内股票怎么对冲.doc](#)

[更多关于《国内股票怎么对冲》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/37163274.html>