

股指期货怎么来规避风险|如何利用股票价格指数期货规避系统性风险-股识吧

一、股指期货的高手请进来，我是做日内的，请问什么经验可传授吗，尽量避免风险的那种，谢谢。

一、主动性原则。

用自己的“主动”进出，把期货交易的风险（赢亏）控制在自己的眼皮子底下。

实现了期货赢亏由“自己说了算”！二、微分化原则。

把赢利、亏损和持仓的时间都“微分化”（特别是亏损），都控制在价差的几元钱之内。

持仓时间最长的，就几分钟；

最短的，就2--3秒钟。

果断进出，决不以任何理由长时间拖延持有亏损的单子。

例如，小麦价从2330涨到2331，仅跳动1个价位（也就是涨了1元钱，这相当于股票涨了1分钱），超过小麦的交易手续费，你就要准备平仓。

三、独立性原则。

这一笔交易，它只是这一笔的，无论它是亏是赢，都与下一笔的交易毫不相关。

你不能因为上一笔交易的盈亏或进出价格的高低，而影响到下一笔交易的果断进出。

四、客观性原则。

做当日短线，最不能容忍的就是：头脑中事先就“主观”地认定了当日行情是涨（或是跌）。

主观地认定今天只能做多或只能做空，这是短线炒手不能有的错误思维。

正确的做法是：不管基本面如何、消息面如何、主力是如何、价格是太高是太低、持单是赢是亏、技术指标是否背离等等，对这些都要统统不与理睬！你只能一心一意客观地“紧紧地跟随”当时盘面（眼前的）价格波动情况”做单。

五、赢亏相当原则。

“赢亏相当”是指，由于我们是“微分化交易”，因此我们每一笔交易的赚和赔的金额大体都会是相等的。

我们之所以能赚钱，是靠“概率”来取胜的。

假定我们的每一笔赚钱和每一笔赔钱是一样多，而我们当天共交易了100次，其中有70次是赚的，30次是赔的，那么我们的这一天就是赚了。

每天只算总帐的盈亏。

当然你最好能力争把每一笔交易的亏损数控制在上一笔交易的赢利数之内就更好了。

换一句话说就是，假如你上一笔交易赚了20元，那么你这一笔的交易最大亏损额就

只能是20元，还没有亏到20元，你就应该提前止损了。

六、停止交易原则。

也可能你今天一上来就交易的很不顺手，老是亏，连着几笔都是亏。

那么当你亏到某个数时，一到这个数，你就坚决平仓关机走人，立即停止今天的任何交易。

这个原则就可以帮助你绝对不会出现一天中连续的大赔。

七、亏损时不加仓不加量原则。

许多人在持有了亏损单的时候，不是采取立即“主动”退出的原则，而是用资金去“死扛”，并且还不断的加码。

这是最愚蠢的做法！最后大赔或暴仓的大都是这些人！八、单量相对稳定原则。

无论你的资金有多大，只做一个固定的手数。

不要因交易顺手情况好就多做几手，看情况差就少做几手。

九、不持仓过夜的原则。

无论什么时候、什么情况下，也无论是否盈亏，每天一到收盘前，你都要一律“全部平仓”，无论赚赔，明天再说。

这样你就可以把期货的隔夜大风险全都避开掉！你就可以轻轻松松地把输赢的主动权掌握在自己手中。

十、第一时间原则。

只在价格转向的第一时间入市。

没有踏准节拍的、过了第一时间的就不追了。

要耐心等待第二个转向点的机会。

十一、258法则。

当价格的个位数逢2、逢5、逢8，十位数的逢2、逢5、逢8，百位数的逢2、逢5、逢8，都是我们重点关注的主力做多做空的分界点。

258法则的具体使用方法是：1、预测上涨或下跌的目标价。

2、决定具体的买进卖出或止损的点。以上11项原则你都执行好了，你就能稳定的赚钱了。

当你做的不好的时候很可能就是违背了这11项原则。

你对照这11项检讨一下，看看是违背了那一条。

市场永远是在无序的波动之中，炒手对于买入卖出的方向性选择不是靠对长期趋势的判断，而是靠自己对于价位下一次波动的预期。

短线炒手赚取的是当天交易的波动利润，绝对不能隔夜持仓。

短线交易一旦亏损立即止损出局，每笔交易的亏损尽量不要超过一个波动价位，必须把短线炒作和普通趋势投资严格区别开来。

二、投资者如何规避股指期货的风险

- 1 制定很好的止损策略，不论是形态止损还是价格止损。
 - 2 尽量找到适应自己的投资方式，不要盲目的做投资，更不要赌博似的做单。
 - 3 控制好自己的仓位，别满仓。
 - 4 学会认输，自己的单子发现做错，就严格止损，不要意气。
- 个人理解的就是这么多了，这里面是一个充满诱惑的市场，自己要有克制力。

三、如何利用股票价格指数期货规避系统性风险

金融资产价格波动的风险最终可分为两种：一种是担心价格上涨，另一种是担心价格下跌。

为此，股指期货的避险功能可分为买入与卖出套期保值两种类型，投资者可以根据自己的股票投资计划选择其中一种。

买入保值是针对股市看涨的一种保护措施，投资者若要在未来某个时间买入一个股票组合，为防止价格上涨多支付购买成本，先在期货市场上买入与股票组合价值相当的股指期货合约，锁定实际购买成本。

卖出保值是针对股市看跌的一种保值措施，投资者若要在未来某个时间卖出股票组合，为避免在实际卖出时价格下跌，先在期货市场上卖出与现货股票组合价值相当的股指期货合约，以锁定盈利。

利用期指进行保值还要考虑期限匹配的问题。

将来推出的沪深300指数期货有四个合约可选择：当月、下月及连续的两个季月。投资者选择期货合约的交割月份最好是与未来买入或卖出股票组合的时间相同或相近。

其次要考虑期货合约流动性，一般而言，可以选择流动性好的近月合约，当近月合约进入交割期时，平掉该合约而将保值头寸转到下个月份合约。

在利用股价指数期货进行套期保值时，通常根据贝塔系数来确定和调整套期保值所需的期货合约数，以尽可能地使系统风险得到防范。

贝塔系数是用来衡量一种证券(或一组证券)风险与整个证券市场的风险程度之间的关系的指标。

例如，某股票的贝塔系数为1.5，就表示如果整个股市价格下跌10%，则该股票价格将下跌15%。

计算套期保值所需的期货合约数的公式为： $(\text{现货总价值}/\text{期货合约的价值}) \times \text{贝塔系数}$ 。

由此公式可知，当现货股票或证券组合的总值一定时，贝塔系数越大，则所需的期货合约数就越多；

贝塔系数越小，则所需的期货合约数就越少。

结束套期保值的简单方法为，选择与现货股票组合操作的时间相一致，即在了结现

货股票头寸的同时结束期货保值交易，两边同时平仓。

当然，也可以根据市场状况灵活操作。

值得注意的是，若持有股票组合头寸规模不大，且组合与市场系统性风险相关性比较低时，没有必要进行保值。

此外，套期保值操作也有风险。

在实际操作中，套期保值面临较多的不确定性，可能影响保值效果，比如组合价值、期限匹配等。

因此，投资者要了解保值原理、熟悉操作程序、认识影响保值效果的因素，只有在充分准备的情况下，才能够有效规避市场系统性风险，锁定收益或者构建组合的成本。

四、投资者拥有一批股票，出于规避风险的动机，准备利用股指期货来降低股票市场震荡对自己的冲击，应该如何操

在股指期货市场上卖空相当数量的期指合约。

这样当你的股票下跌亏损时，你卖出的期指合约将有盈利，来对冲股票下跌的风险。

五、如何规避股市风险 规避股市风险方法有哪些

开通股指期货，可以通过做空来规避股市风险，尤其可以规避系统性风险。有兴趣可以联系我。

六、如何利用期货市场规避股市风险？

这个对于企业来说的，我说的简单点好了，因为期货可以做多（涨了赚钱）也可以做空（跌了赚钱）。

如果现货涨了，你只要在期货市场上做空一样可以平衡输赢（现货虽然输钱，期货上做空可以赚钱）所以就变相规避了风险

参考文档

[下载：股指期货怎么来规避风险.pdf](#)

[《亿成股票停牌多久》](#)

[《购买新发行股票多久可以卖》](#)

[《股票交易后多久能上市》](#)

[《股票抛股要多久》](#)

[下载：股指期货怎么来规避风险.doc](#)

[更多关于《股指期货怎么来规避风险》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/chapter/34548541.html>