

一张期权合约对冲多少市值股票会大涨、怎么用期权对冲股市风险-股识吧

一、一张股指期货合约应该买多少钱的股票才能对冲风险?知道的说说下哦？

以沪深300的股指期货为例，中金所规定每点价值为300元。
如果按2022年12月12日收盘价计算，一张合约的价值是 $2266 \times 300 = 679,800$ 元。
完全对冲掉，你可以需要照沪深300指数按权重买进300只股票。
也许者买进等同价值的300etf基金。

查看原帖 >

>

求采纳

二、一张股指期货合约应该买多少钱的股票才能对冲风险

一张合约的价值是 $2500 \times 300 = 750000$ 元。

三、股票期权一张合约多少股票

股票期权合约单位指单张合约对应的标的证券（股票或ETF）的数量。
股票期权合约单位如下：1）20元（含）以下 每张合约标的正股数为10000股；
2）20元至100元（含） 每张合约标的正股数为5000股；
3）100元以上 每张合约标的正股数为1000；

对于ETF期权合约单位为 10000。

当标的证券发生权益分配、公积金转增股本、配股等情况时，会对该证券作除权除息处理；

此时期权合约需要作相应调整，调整后合约单位取其整数部分，对剩余尾数按除权除息日调整后参考权利金对权利方和义务方进行结算（义务方向权利方支付剩余尾数*调整后参考权利金*张数）。

由于价格变动加挂新的合约以及挂牌新月份的合约，采用调整前的合约单位。

四、怎么用期权对冲股市风险

说的是对的。

不过仓位及点差一定要一样才有对冲作用，不过你还是没有赚。

五、期权对上证50股票有涨跌限制吗

熔断机制连续竞价期间，期权合约盘中交易价格较最近参考价格涨跌幅度达到或者超过50%且价格涨跌绝对值达到或者超过5个最小报价单位时，期权合约进入3分钟的集合竞价交易阶段涨跌幅限制
认购期权最大涨幅 = $\max \{ \text{合约标的前收盘价} \times 0.5\%, \min [(2 \times \text{合约标的前收盘价} - \text{行权价格}), \text{合约标的前收盘价}] \times 10\% \}$
认购期权最大跌幅 = $\text{合约标的前收盘价} \times 10\%$
认沽期权最大涨幅 = $\max \{ \text{行权价格} \times 0.5\%, \min [(2 \times \text{行权价格} - \text{合约标的前收盘价}), \text{合约标的前收盘价}] \times 10\% \}$
认沽期权最大跌幅 = $\text{合约标的前收盘价} \times 10\%$

六、李四持有 30 手沪深 300 股指期权，每手的 delta 为 0.5，为了对冲沪深 300 指数变

上证50etf非个股期权，它是指数期权，对应的合约标的不是股票而是“50ETF”基金。

上证50ETF期权的基本条款如下：（一）合约类型。

合约类型包括认购期权和认沽期权两种类型。

（二）合约单位。

每张期权合约对应10000份“50ETF”基金份额。

（三）到期月份。

合约到期月份为当月、下月及随后两个季月，共4个月份。

首批挂牌的期权合约到期月份为2022年3月、4月、6月和9月。

（四）行权价格。

首批挂牌及按照新到期月份加挂的期权合约设定5个行权价格，包括依据行权价格间距选取的最接近“50ETF”前收盘价的基准行权价格（最接近“50ETF”前收盘价的行权价格存在两个时，取价格较高者为基准行权价格），以及依据行权价格间距依次选取的2个高于和2个低于基准行权价格的行权价格。

“50ETF”收盘价格发生变化，导致行权价格高于（低于）基准行权价格的期权合约少于2个时，按照行权价格间距依序加挂新行权价格合约，使得行权价格高于（低于）基准行权价格的期权合约达到2个。

（五）行权价格间距。

行权价格间距根据“50ETF”收盘价格分区间设置，“50ETF”收盘价与上证50ETF期权行权价格间距的对应关系为：3元或以下为0.05元，3元至5元（含）为0.1元，5元至10元（含）为0.25元，10元至20元（含）为0.5元，20元至50元（含）为1元，50元至100元（含）为2.5元，100元以上为5元。

参考文档

[下载：一张期权合约对冲多少市值股票会大涨.pdf](#)

[《认识股票限价买入什么意思》](#)

[《为什么这么多股票讲课》](#)

[《企业账本印花税什么交》](#)

[《etf指数基金为什么可以涨停》](#)

[《深信服是什么股》](#)

[下载：一张期权合约对冲多少市值股票会大涨.doc](#)

[更多关于《一张期权合约对冲多少市值股票会大涨》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/store/55254292.html>