

股票组合怎么做__股票与期货：怎样组合投资-股识吧

一、股票与期货：怎样组合投资

这个也是要结合投资者自己的情况看的，收入，投资经验之类的都会影响的。

二、如何构造套利组合

小张是位新股民，除了日常进行股票交易外，业余时间不忘学习证券、期货相关知识，遇有不明之处相关向相关经营机构请教。

这天小张在报纸上看到有关股指期货期现套利的文章，很感兴趣，但对于其中提到的有关期现套利现货投资组合的构造部分没有完全理解，于是拨通上海某知名期货公司的咨询电话。

"我现在知道期现套利的原理是如果股指期货价格偏高，就在现货市场做多，在期货市场做空，待价格回归后，再行在现货市场和期货市场平仓，但我没弄明白，现货市场也没有沪深300指数可供买卖的，如何实现在现货市场的操作呢？"小张不解的问。

"可以通过构造一定的股票投资组合或购买基金产品实现。

"期货公司的工作人员回答道。

"什么样的股票组合才适合呢期现套利呢？"小张接着又问。

"最好是与沪深300指数关联程度比较高的股票组合，有两种方法，一种是完全拟合法，就是按照沪深300指数构造方案构造股票组合；

另一种方法是选取一定样本样本股，建立关联度较高的组合。

"期货公司的工作人员回答道。

"每次要买三百种股票，好操作吗？是不是选取少量样本股的投资组合更好些？"小张一边按着计算器一边问。

"各有利弊，完全拟合操作难度大，但关联度好；而简化样本股组合操作难度小，但关联度不稳定。

"期货公司的工作人员回答道。

"您刚才还提到可以通过购买基金的方式，指的是买什么样的基金？"小张关切的问道。

"主要是etf基金，如上证50etf.因为上证50指数走势与沪深300指数相关性很高。

"期货公司的工作人员回答道。

"到底哪一种更好呢？"小张一边问一边看着上证50etf行情走势一边问。

"期现套利结果的好坏一方面取决于模型构造，一方面取决于市场实际情况，没有哪一种方法更好，只有哪一种方法更适合市场实际情况。

比如大家都用证50etf进行期现套利就会出现，大家集中购买证50etf基金的情况，自然证50etf基金价格会上涨，期现套利成本就增加，套利效果就会大打折扣。

"期货公司的工作人员回答道。

风险提示：期现套利交易除了模型构造存在一定的资金管理风险及技术操作风险外，选择的模型是否符合市场实际情况也是期现套利效果好坏的关键因素，建议普通投资者通过专业机构参与股指期货期现套利交易。

三、股票组合的加权平均收益怎么算

$(A股票的盈亏幅度 * 持有的股数 + B股票的盈亏程度 * 持有股数) / 投入的总资金量 * 100\%$

四、给客户做一个10万元的证券投资组合建议，组合中需要有基金，股票和衍生品，要具体到什么证券，多少股票

10万元的投资组合建议真的是有些小，不过考虑到客户的理财需求。

还是要尽心为客户服务。

首先你在做配置之前，要告诉我们，客户的风险承受能力，或者能不能接受高风险品种，基金，股票，以及衍生品特别是这个衍生品，很含糊，到底是什么衍生品，金融衍生品有很多很多，有低风险的也有高风险的。

如果不了解客户风险承受能力，盲目给客户一个不适当的投资建议，恐怕是现在不管是银行，证券，还是保险的客户经理面临最多的投诉吧。

五、如何利用组合条件找潜力股 请各位高手告诉我哪些条件能找到牛股。

$(A股票的盈亏幅度 * 持有的股数 + B股票的盈亏程度 * 持有股数) / 投入的总资金量 * 100\%$

六、简述投资基金经理构造股票投资组合的一般流程

一、要有自己的投资理念。

许多投资人盲目地跟着市场、他人买卖基金，哪只基金涨幅居前就追买哪只，完全没有把资金的安全边际放在第一位。

建议入市之前，好好学一学基金理财知识，权衡自己的风险承受能力，同时了解国家的经济动向或趋势，然后把握投资策略。

二、明确目标持续性投资。

各类股票基金各有其特色，各有其特点。

如果你正处于生命的积累阶段，要投资未来购房、孩子上学费用，那么，你就首选成长型股票基金为主；

如果你正处于生命周期的分配阶段，既要供孩子上学，又要自己养老，那么，你就选收入型股票基金（价值型基金）为主。

总之，一定要清楚自己持有基金组合所期望达到的目标，坚持持续性地投资。

三、投资一定要有核心组合。

你的投资组合的核心部分应当有哪些主流基金组成？我非常认同股票投资的“核心——卫星”策略，在投资基金时也同样适用。

你应从股票基金中（主动型、偏股票型、平衡型）选择适合自己的、业绩稳定的优秀基金公司的基金构成核心组合。

年轻的可占你基金组合资金的80%，年老的可占40%——50%，另用10%投资防守型基金（债券基金和货币基金），用10%投资在市场中业绩表现出色的为你的卫星基金，获得较高收益。

四、投资指数基金“不投资指数基金是你的错。”

借用巴菲特的话来指导自己的投资技巧。

今年的市场也证明了他的经验。

因而，在每种组合投资中，应拥有1——2只股票市场的指数基金。

如嘉实300和中小板ETF，这种拥有整个市场法不失为明智的方法。

五、不要将同类型基金做组合。

尽管各基金的名称不同，但注意“不管切得多薄，香肠片也还是香肠。”

将同类型基金做组合是无效的。

如果持有同类基金只数过多，会使你的组合失衡，不知不觉中让你放大了市场风险，阻碍了你的投资目标的实现。

有效的基金组合应是不同类型如股票型（主动型、偏股型和平衡型）、债券型、货币型等不同类型。

六、投资的期望值不要过高。

市场经历了2005年的股改，助推了基金翻番的业绩，在很大程度上可以说是对股改前市场的补涨。

这样的业绩在成熟市场是不可遇见的。

投资者应降低对市场的投资收益。

针对我们的新兴市场，把预期收益调整约为30%左右就行了。

七、求教如何构建有效投资组合

任务占坑

参考文档

[下载：股票组合怎么做.pdf](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《买股票要多久才能买到》](#)

[下载：股票组合怎么做.doc](#)

[更多关于《股票组合怎么做》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/12114618.html>