

股指期货持仓大幅增加风险怎样- 股指期货+风险度多少会被强平？-股识吧

一、操作股指期货风险大吗

股指期货风险大。

股指期货是一种以股票价格指数作为标的物的金融期货，具有股票和期货的双重属性。

股指期货与股票相比具有保证金交易、每日结算、强制平仓、双向操作、T+0制度、到期交割等特点。

”陶金峰解释，股指期货保证金初步定为合约价值的12%，在此基础上各经纪公司会根据市场风险的变化进行一定调节，调整后大致在15%左右，每手合约所需保证金大约为18万。

股指期货保证金账户资金分为两部分，一是持仓已经占用的交易保证金，二是剩余未被占用的结算准备金。

持仓部分每天收盘后结算，结算价格为期货合约最后一小时加权平均价。

如果持仓有盈利，盈利部分直接划转到结算准备金；

如果持仓有亏损，则将结算准备金相对应的资金划转进来弥补不足。

如果结算准备金不够弥补亏损，则需要及时追加，否则将面临强行平仓。

股指期货使用现金交割，交割结算价采用到期日沪深300指数最后两小时所有指数点算术平均价。

股指期货风险大 对习惯炒股票的投资者来说，股指期货省去的只是选股的麻烦。

但股指期货的保证金交易使得投资者的盈利与亏损同步放大，小散户需更加小心谨慎。

从统计来看，沪深300指数日均涨跌幅在0.95%左右，假设沪深300指数期货日均波动幅度为1%，按照10%的保证金率，意味着投资者收益的波动为 $\pm 10\%$ ，假设投入股指期货保证金为20万元，日均盈亏2万左右，比股票波动大很多。

“相对于股票，股指期货的专业性更强，中小散户资金量有限、专业知识储备不够以及技术分析不到位等因素都会增加潜在风险，所以投资股指期货对小散户来说风险更大。

”

二、请问：股指期货持仓量对于现货（股票）市场有什么样的影响？谢谢...

股指期货持仓：1、持仓量增大，说明市场活跃；
2、持仓量分多头与空头。
多头量大，市场上涨的可能性大；
反之亦然。
股指期货对现货有价格引导作用，叫价格发现。

三、股指期货套利的风险有哪些

一、套利交易过程中因为某个交割月份出现单边行情而可能被强制减仓的风险套利交易的基本原则是交易者同时进行数量相同、方向相反的交易，同时平仓并同时开仓。

但按照股指期货风险控制管理办法，当某个交割月份出现连续单边行情时，交易所所有权对该合约的持仓实行强制减仓。

由于股指期货收盘的时间比股市晚15分钟，如果在股市收盘后，股指期货市场启动了交易所强制减仓措施，由于交易所执行股指期货的强制减仓对套利头寸并没有优惠待遇，那么在股指期货市场持有的套利头寸就有可能被交易所强制减仓。

如果套保者或期现套利者的期货头寸被强制减仓，就会导致股票现货头寸的风险暴露。

二、由于保证金追加不及时而被强行平仓的风险套利交易需要在期现市场、同一个市场不同交割月份、同一市场相关交易品种或者同一品种不同交易市场同时进行方向相反的交易，由于截止到目前为止国内股指期货交易规则中并未对套利交易在手续费和保证金方面给予优惠，因此套利交易相对于单纯的投机在交易保证金和手续费方面成本要增加一倍。

此时，如果股指期货出现行情大幅波动，无论交易所提高保证金水平还是套利交易者弥补浮动亏损都需要追加大量的保证金，此时，套利交易者追保的压力要明显大于单纯的投机交易，如果该套利交易者不能及时将保证金追加到位，该交易则面临某个交割月持仓被强制平仓的风险，一旦某个合约被强制平仓，另一个期货合约就变成单向投机交易，套利交易者就需要承担相应的投机风险。

三、套利交易过程中可能产生较大的冲击成本，冲击成本可能冲抵套利利润甚至导致套利出现亏损跨期套利交易者需要在同一个市场上两个不同交割月份上同时进行数量相同、方向相反的交易，从目前国外股指期货的实际运行情况看，股指期货往往集中在某一个交割月份，其他交割月份交易往往比较清淡。

在股指期货个别交割月流动性出现不足时，如果在该月份交易可能出现要么不能及时成交、要么成交价格距离自己的预想差距很大，这种情况可能会加大套利成本，影响到套利利润，甚至导致套利出现亏损。

四、期现套利时，由于现货股票组合与指数的股票组合不一致可能产生模拟误差股

指期货市场上，期现套利是一种主要的套利形式。

准确的期现套利要求卖出或买进股指期货合约的同时，在现货市场上买进或卖出与其相对应的股票组合。

但在实际操作过程中，两者很难做到准确对应。

四、如果股指期货的持仓比例控制的合适，就能够将市场下跌的风险完全消除？？

如果想参与股指期货，我建议你暂时不要考虑了。

参与股指期货要求是很高的，需要机构，和大资金量。

每一单就是几万块，几十万上百万都是小钱，保证金都不一定能够，建议不要参与了。

这个螃蟹不是散户吃的。

五、股指期货风险大不大？

看你怎么做，你要是和股票做对冲风险不大，你要是投机，肯定有风险，但是盈利也大

六、请问：股指期货持仓量对于现货（股票）市场有什么样的影响？谢谢...

七、股指期货+风险度多少会被强平？

股指期货合约最低交易保证金标准为10%，这是交易所收的基准保证金水平，通常情况下期货公司还会在这个基础上加收1到2个百分点。

在实际期货交易中，当交易所认为市场风险状况增大时，将对基准保证金标准进行调整，这些状况主要包括：股指出现涨跌停板单边市、遇国家法定长假日以及交易

所认为市场风险变化等情形。

参考文档

[下载：股指期货持仓大幅增加风险怎样.pdf](#)

[《股票前一秒涨停后一秒跌停说明什么》](#)

[《股票成交数量红色绿色代表什么意思》](#)

[《特高压有什么股票600869》](#)

[《同花顺怎么恢复默认》](#)

[下载：股指期货持仓大幅增加风险怎样.doc](#)

[更多关于《股指期货持仓大幅增加风险怎样》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/31006814.html>