

股指期货基差基差率如何计算—股指期货基差问题-股识吧

一、股指期货是怎么计算的?求解答

期货与现货相对。

期货是现在进行买卖，但是在将来进行交收或交割的标的物，这个标的物可以是某种商品例如黄金、原油、农产品，也可以是金融工具，还可以是金融指标。

交收期货的日子可以是一星期之后，一个月之后，三个月之后，甚至一年之后。

买卖期货的合同或者协议叫做期货合约。

买卖期货的场所叫做期货市场。

股指期货：全称是股票价格指数期货，也可称为股价指数期货、期指，是指以股价指数为标的物的标准化期货合约，双方约定在未来的某个特定日期，可以按照事先确定的股价指数的大小，进行标的指数的买卖。

作为期货交易的一种类型，股指期货交易与普通商品期货交易具有基本相同的特征和流程由于股指期货具有交易成本低、保证金比例低、杠杆倍数高等特点，股指期货的推出在短期内将会降低部分偏爱高风险的投资者由股票市场转向期指市场，产生一定的资金挤出效应，股市的资金会流向期市，造成股市暂时失血。

二、股指期货如何计算卖出或买入期货的合约数要详细的过程和解答

期现货价值比等于 1.25 ，那么现货价值是2.25亿元，期货价值是 $\text{合约数量} \times 5700 \times 300$ （因为沪深300指数合约每点300元），那么就可以得出下面计算： $(225000000 \times 0.8) / (5700 \times 300) = 105.26 \sim 106$ 张因为收益率达到25%，怕收益下降，所以要做卖出套期保值的一个操作。

谢谢！希望对你有帮助。

三、股指期货价差套利是如何操作的？

股指期货，全称是股票价格指数期货，也可称为股价指数期货、期指，是指以股

价指数为标的物的标准化期货合约，双方约定在未来的某个特定日期，可以按照事先确定的股价指数的大小，进行标的指数的买卖，到期后通过现金结算差价来进行交割。

作为期货交易的一种类型，股指期货交易与普通商品期货交易具有基本相同的特征和流程。

股指期货是期货的一种，期货可以大致分为两大类，商品期货与金融期货。

1、套利交易具有风险相对小、收益稳定、成本低等特点，受到投资者的广泛欢迎。

根据我们的测算，股指期货期现套利的无风险年收益率在15%-20%左右，适用于资金量大、风险偏好低的投资者，也适用于市场大势不明时，资金量适宜的普通投资者。

2、期现套利原理股指期货现金交割和交割结算价确定的相关规则，使得到期日期货价格收敛于现货价格。

如果不考虑交易成本，一旦期货指数价格偏离现货指数价格，就可以通过套利交易锁定利润。

但实际操作中，由于存在买卖手续费，冲击成本、资金利息等成本，实际存在无套利区间。

在无套利区间内投资者进行套利操作，不但不能获取利润，甚至可能亏损。

只有当期货价格跃出无套利区间，投资者进行套利操作才能取得无风险收益。

3、如果期货价格跃出无套利区间上边界，则买入现货的同时，在期货合约上开仓卖出，期望价差缩小后，通过对冲平仓或者交割来获取预期的价差收益；

如果期货价格跌破无套利区间下边界，则卖出现货的同时，买入期货合约，以期获利。

四、股指期货套利计算

根据公式 $f = se^{(r-d)t}$ ，其中e之后的为e的上标。

3个月后标准普尔期货价格 $= 1000e^{(10\%-5\%) \cdot 3/12} = 1012.578$ 。三个月后指数现货点1100，那么 $1100 - 1000 = 100$ ；

期货差， $1012.578 - 950 = 62.578$ ；

套利，买现货卖期货。

总盈利 $= 100 - 62.578 = 37.422$

五、沪市，股指的计算公式？或者简单说一下如何计算的？

一张股指期货合约的合约价值用股指期货指数点乘以某一既定的货币金额表示，这一既定的货币金额称为合约乘数。

股票指数点越大，或合约乘数越大，股指期货合约价值也就越大。

沪深300股指期货的合约乘数为每点人民币300元。

当沪深300股指期货指数点为3000点时，合约价值等于3000点乘以300元，即90万元；

当指数点为4000点时，合约价值等于4000点乘以300元，即120万元。

六、股指期货基差问题

基差并不完全等同于持仓费用，但基差的变化受制于持仓费用。

归根到底，持仓费用反映的是期货价格与现货价格之间基本关系的本质特征，基差是期货价格与现货价格之间实际运行变化的动态指标。

虽然期货价格与现货价格的变动方向基本一致，但变动的幅度往往不同。

所以，基差并不是一成不变的。

随着现货价格和期货价格持续不断的变动，基差时而扩大，时而缩小，最终因现货价格和期货价格的趋同性，基差在期货合约的交割月趋向于零。

如果在期货建仓或轧平仓位时基差有所变化，那么银行进行期货交易就可能产生一笔损失，减少交易者在现货市场的收益。

不过在一般情况下基差风险会小于现货市场上的利率风险，也正因为如此，商业银行和客户才利用金融期货交易来规避利率风险。

七、股指期货基差的名词释义

基差的概念。

我们知道，基差是股指期货标的指数价格与股指期货价格之间的差值，比如，在4月6日某时点，沪深300指数为3250点，IF1004合约价格为3310点，则此时的基差为 $3250-3310=-60$ 点。

由于现货价格与期货价格的变化幅度不完全相同，因而两者之间的价格差、即基差的大小可能发生着变化。

比如在4月6日的另一时刻，沪深300指数为3260点，IF1004合约的价格为3315点，则此时的基差变为 $3260-3315=-55$ 点。

一般情况下，基差总是处于不断的变化中。

八、沪深300股指期货基差是什么意思

基差=现货价格-期货价格可以是正可以是负

九、中国股指期货的计算方法

沪深300股指期货报价的最小变动点是0.2点，由于沪深300股指期货合约的乘数为300元，故一个合约的最小波动点是0.2元X300元=60元。

最后交易日是合约到期月份的第三个周五，遇法定节假日顺延，最后结算日同最后交易日。

参考文档

[下载：股指期货基差基差率如何计算.pdf](#)

[《浙江中控技术股份有限公司什么时候上市》](#)

[《股票华胜天成是做什么的》](#)

[《股份有限公司什么性质》](#)

[《苹果公司市值万亿是一个什么概念的股票》](#)

[《科创板企业的信息披露规定是什么》](#)

[下载：股指期货基差基差率如何计算.doc](#)

[更多关于《股指期货基差基差率如何计算》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/41215434.html>