

持有股票如何套期保值...持有空头看跌期权时，利用股指期货套期保值的方向是?-股识吧

一、权证和股票要怎么操作才能实现套期保值

如果看空后市，那就可以卖出期指合约套利不过您似乎想问一种跨期的套期保值法，这叫作蝶式套利。

原则是：比如“长期”看空，当前1月，则可买入3月的合同，但在6月到期的合约上做空头，卖出等量合约，达到对冲获利的目的。

看多则反之，近空远多

二、套期保值的理论及其运用

如需套期保值，请加扣扣 ；

详聊 ；

我们主要帮客户套期保值和帮客户投资赚钱

三、套期保值准则规定的套期会计方法条件

 ；

第六条 ；

套期关系只有符合以下全部条件时，企业才能运用本准则规定的套期会计方法进行处理： ；

 ；

 ；

 ；

(一)在套期开始时，企业对套期关系有明确指定，且具有关于套期关系、风险管理目标和套期策略的正式书面文件，至少应载明套期工具、被套期项目或交易、被套期风险的性质，以及套期有效性评价方法等内容。

 ；

 ；

 ；

 ；

被套期风险应当具体和可辨认，并将最终影响企业的损益。

套期有效性，指套期工具的公允价值或现金流量变动，能够抵销被套期风险引起的被套期项目公允价值或现金流量变动的程度。

 ;

 ;

 ;

 ;

(二)该套期高度有效，且与企业最初为相关套期关系所确定的风险管理策略相吻合

。

 ;

 ;

 ;

 ;

(三)对于预期交易的现金流量套期，该预期交易将很可能发生，且其现金流量变动将最终影响企业的损益。

 ;

 ;

 ;

 ;

(四)套期有效性可以可靠地计量，即与被套期风险有关的被套期项目公允价值或现金流量和套期工具的公允价值，均能可靠地计量。

 ;

 ;

 ;

 ;

(五)企业将持续地对套期有效性进行评价，确保在套期关系存续期内该套期关系高度有效。

有帮助请评价采纳 ;

 ;

谢谢！

四、什么是套期保值？

套期保值指在期货市场上买入(或卖出)与现货市场交易方向相反、数量相等的同种商品的期货合约，进而无论现货供应市场价格怎样波动，最终都能取得在一个市场上亏损的同时在另一个市场盈利的结果，并且亏损额与盈利额大致相等，从而达到规避风险的目的。

五、如何规避股票期权交易风险

以套利或者套保的策略来操作，风险就变成有限的。
比如你有股票，在确定价格卖出认购期权，这样风险就是可控的。
或者，你可以选择在不同的行权价格进行套利交易，这样一买一卖，最后你的亏损也是可控的。

六、持有空头看跌期权时，利用股指期货套期保值的方向是？

持有空头看跌期权，也就是卖出看跌期权，这个时候你是多头，利用股指期货套期保值 拿就应该是卖出套期保值

七、套期保值是什么，通俗易懂的讲

就是用来规避风险或者降低风险的一种手段或者工具。
比如所谓的期货、期权、远期就是套期保值的衍生品。
套期保值又叫做对冲，指企业在一个平台上面交易，会产生风险度以及风险价格。
套期保值(Hedge或Hedging)，是指企业为规避外汇风险、利率风险、商品价格风险、股票价格风险、信用风险等，指定一项或一项以上套期工具，使套期工具的公允价值或现金流量变动，预期抵消被套期项目全部或部分公允价值或现金流量变动风险的一种交易活动。
为了在货币折算或兑换过程中保障收益锁定成本，通过外汇衍生交易规避汇率变动风险的做法叫套期保值。

八、权证和股票要怎么操作才能实现套期保值

如何发挥权证的套期保值和风险治理的功能与作用? 答：通常情况下，投资者在拥有某股票的情况下，会购买相应股票的认沽权证，以对冲该股票价格下跌所带来的损失；

而卖空股票时，则会购买相应股票的认购权证，用以规避该股票价格上升给投资者所造成的损失。

由于我国内地尚不具有卖空机制，所以，不会有卖空股票的现象出现，这是不是认购权证就派不上用处了呢?也不是这样的，不具有某股票的投资者，假如购买该股票的认购权证，就可以起到比直接购买该股票还要好的效果，因为，购买该认购权证收益不封顶、损失却可以保底。

概括地讲，从控制风险的角度讲，拥有某股票的投资者，可以购买该股票的认沽权证规避风险，切不可去购买该股票的认购权证，否则的话，会适得其反，增加风险。

当然，投资者要购买认购权证的话，最好去购买手上没有该股票的认购权证进行避险。

除与标的资产组成套期保值组合外，在日常的投资组合治理中，也可以充分发挥权证的作用，以进一步分散组合风险。

在投资组合治理中，权证比起股票具有两个优点：其一是投资成本小，使得原本无力进行的分散投资成为可能；

其二是权证有认购、认沽之分，其系统风险截然相反，为投资组合提供了更加灵活的选择机会。

不过，我们一般建议投资者只将组合中10%左右的资金放在权证上，因为权证具有杠杆效应，投资过大会将风险过度放大。

投资者应该按照自己的风险承受能力确定投资在权证上的资金。

知道了该如何利用权证进行投资后，我们还应该明白，市场上交易的权证定价是否合理。

参考文档

[下载：持有股票如何套期保值.pdf](#)

[《股票怎么卖在最高的点》](#)

[《中小板年度业绩预告什么时候开始》](#)

[《大涨不放量什么意思》](#)

[下载：持有股票如何套期保值.doc](#)

[更多关于《持有股票如何套期保值》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/read/33214759.html>