

常见的套利策略有哪些.有哪几种期货套利？有什么交易方法或者技巧吗？-股识吧

一、现在股指期货套利都有哪些常用手段

股指期货套利是期货套利交易的一种类型，其原理是在市场价格关系处于不正常状态下进行双边交易以获取低风险差价。

股指期货套利类型有：1、期现套利（当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个市场的价格差距，低买高卖而获利。

）2、跨期套利（在同一期货品种的不同合约月份建立数量相等、方向相反的交易部位，并以对冲或交割方式结束交易的一种操作方式。

）3、跨市套利（利用同一商品在不同交易所的期货价格的不同，在两个交易所同时买进和卖出期货合约以谋取利润的活动。

）4、跨品种套利（通过对两个乃至两个以上品种之间价值差异来捕捉投资机会）

。

二、有哪几种期货套利？有什么交易方法或者技巧吗？

期货套利方法一般有两类，第一种是期现套利，指利用同一种商品在期货市场与现货市场之间的不合理价差进行的套利行为，套利者通过构建现货与期货的套利资产组合，以期望基差在未来回归合理的价值区间并获取套利利润。

第二种是跨交割月份套利（跨月套利），利用同一商品期货合约的不同交割月份之间的差价的相对变动来获利是最常用的。

三、阿尔法套利的具体操作方法

1、多/空策略，就是将基金部分资产买入股票，部分资产卖空股票或者股指期货。对冲基金经理可以通过调整多空资产比例，自由地调整基金面临的市场风险，往往是规避其不能把握的市场风险，尽可能降低风险，获取较稳定的收益。

2、套利策略，就是对两类相关资产同时进行买入、卖出的反向交易以获取价差，在交易中一些风险因素被对冲掉，留下的风险因素则是基金超额收益的来源。

由于采用产品不一，因此套利策略又可以分为：股指套利、封闭式基金套利、统计套利等。

3、事件驱动型策略，就是投资于发生特殊情形或是重大重组的公司，例如发生分拆、收购、合并、破产重组、财务重组、资产重组或是股票回购等行为的公司。事件驱动策略主要有不良证券投资和并购套利，其他策略常与这两种策略一并使用。

4、趋势策略，通过判断证券或市场的走势来获利而不再是将市场风险对冲掉后依靠选择证券的能力来获利，而且有时还大量采用杠杆交易以增加盈利。类型上可以分为：全球宏观基金、新兴市场对冲基金、纯粹卖空基金、交易基金及衍生品基金。

四、期货套利的方法的介绍

五、期货套利的方法的介绍

参考资料来源：中金网

期货市场的套利主要有三种形式，即跨交割月份套利、跨市场套利及跨商品套利。

一、跨交割月份套利（跨月套利）

投机者在同一市场利用同一种商品不同交割期之间的价格差距的变化，买进某一交割月份期货合约的同时，卖出另一交割月份的同类期货合约以谋取利润的活动。其实质，是利用同一商品期货合约的不同交割月份之间的差价的相对变动来获利。这是最为常用的一种套利形式。

比如：如果你注意到

5

月份的大豆和

7

月份的大豆价格差异超出正常的交割、储存费，你应买入

5 ;

月份的大豆合约而卖出 ;

7 ;

月份的大豆合约。

过后，当 ;

7 ;

月份大豆合约与 ;

5 ;

月份大豆合约更接近而缩小了两个合约的价格差时，你就能从价格差的变动中获得一笔收益。

跨月套利与商品绝对价格无关，而仅与不同交割期之间价差变化趋势有关。

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

具体而言，这种套利又可细分为三种：牛市套利，熊市套利及蝶式套利。

、跨市场套利（跨市套利） ;

 ;

 ;

 ;

投机者利用同一商品在不同交易所的期货价格的不同，在两个交易所同时买进和卖出期货合约以谋取利润的活动。

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

当同一种商品在两个交易所中的价格差额超出了将商品从一个交易所的交割仓库运送到另一交易所的交割仓库的费用时，可以预计，它们的价格将会缩小并在未来某一时期体现真正的跨市场交割成本。

比如说小麦的销售价格，如果芝加哥交易所比堪萨斯城交易所高出许多而超过了运输费用和交割成本，那么就会有现货商买入堪萨斯城交易所的小麦并用船运送到芝加哥交易所去交割。

 ;

、跨商品套利 ;

 ;

 ;

 ;

所谓跨商品套利，是指利用两种不同的、但是相互关联的商品之间的期货价格的差异进行套利，即买进（卖出）某一交割月份某一商品的期货合约，而同时卖出（买入）另一种相同交割月份、另一关联商品的期货合约。

六、期货套利分析方法有哪些？

以股指为例，1、是当期货实际价格大于理论价格时，卖出股指期货合约，买入指数中的成分股组合，以此获得无风险套利收益，称为“正套”。

2、是当期货实际价格低于理论价格时，买入股指期货合约，卖出指数中的成分股组合，以此获得无风险套利收益，称为“反套”。

这两种办法同样适用于商品期货套利。

七、请教高手：套利的方式和具体手段有哪些？谢谢了。

期货套利交易09-5-25 23:14如果价差高于持仓费，套利者就可以通过买入现货，同时卖出相关期货合约，待合约到期时，用所买入的现货进行交割。

价差的收益扣除买入现货之后发生的持仓费还有剩余，从而产生套利的利润。

相反，如果价差远远小于持仓费，套利者就可以通过卖出现货，同时，买入相关期货合约，待合约到期时，用交割获得的现货来弥补之前所卖出的现货，价差的亏损小于所节约的持仓费用，因而产生盈利。

不过，对于商品期货来说，优于现货市场缺少做空机制，从而限制了现货市场卖出的操作。

因此，最常见的就是你所问的情形，期货价格高于现货价格的时候，进行套利。

套利分同品种的跨期套利、不同品种的跨品种套利和跨市场套利。

一般情况下，因为库存费用的存在，期货价格是大于现货价格的，远期合约的价格大于近期合约的价格的，这就是一般而言的正向市场；

相反，如果期货价格小于现货价格，远期合约的价格小于近期合约的价格的话就是反向市场，出现这种情况的原因可能是现货市场上供应太少，或者是需要太大，所以大家愿意给现货和近月合约以较高的价格。

当期货价大于现货价时，该如何进行套利？这其实是市场的正常情况，在这种情况下只能判断价差的变化，根据价差变化方向的判断来决定是抛期货买现货，还是抛现货买期货，还要考虑到目标利润应大于持有现货或期货交割的成本。

个人空间里有我的联系方式。

八、分级基金折算套利策略有哪些

配对转换套利是最常用的一种套利模式，即利用分级基金的配对转换机制和折溢价水平来进行套利操作，基本形式包括溢价(分拆)套利和折价(合并)套利两种。

溢价套利溢价套利流程主要包括三个步骤：申购、分拆以及卖出。

T日在一级市场进行母基金份额的申购，T+2日确认母基金份额到账申请分拆成A份额及B份额，T+3日在二级市场进行A、B份额的卖出。

折价套利折价套利流程主要包括三个步骤：买入、合并以及赎回。

T日在二级市场分别买入A份额及B份额，T+1日进行A、B份额的合并，T+2日将合并后的母基金份额在一级市场完成赎回。

参考文档

[下载：常见的套利策略有哪些.pdf](#)

[《大族激光股票为什么大幅下跌》](#)

[《股票代码前面一个宗是什么意思》](#)

[《为什么说饭量小的比饭量大的人命长》](#)

[《开通北交所后要一直保持日均50万吗》](#)

[下载：常见的套利策略有哪些.doc](#)

[更多关于《常见的套利策略有哪些》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/subject/73882027.html>