这篇文章给大家聊聊关于股指期货的无套利区间，以及股指期货的无套利区间计算对应的知识点，希望对各位有所帮助，不要忘了收藏本站哦。

本文目录

1. 香港那边的股指期货套利空间大吗？
2. 股指期货与融资融券做空机制有什么区别
3. 股指期货跨品种单向大边保证金制度是什么？对期货市场会有什么影响？
4. 期货套利如何做？

香港那边的股指期货套利空间大吗？

他乡的月亮未必是圆的。国内的市场都没做好何必想那么多呢。当然做投资肯定是哪里好投哪里，但在没有深入了解之前不要动手，毕竟人家的规则可能和我们的一样。

股指期货与融资融券做空机制有什么区别

从应用便利性的角度讲。

第一，融券更灵活，可以任意调整不同个股的卖空比例。而股指期货一篮子卖空，各股票的相对比例是不能调整的。

换言之，当你只想卖空一只在沪深300指数中权重很小的成分股时，你不得不同时卖空其它299只股票，非常不便利。

第二，股指期货流动性好，而融券有时断货。

第三，股指期货交易成本低，只有名义金额的万分之一左右吧。融券卖空就要交千分之一左右的手续费了吧。

第四，股指期货不是借，所以没成本，融券是借别人东西，年息约10%第五，股指期货杠杠高，7倍左右，融券估计两倍左右。资金效率差不少～个人觉得，如果融券券源充足，并且年息低一些（靠指数基金持股转融通），其实是可以取代股指期货目前的主导地位的。

股指期货跨品种单向大边保证金制度是什么？对期货市场会有什么影响？

所谓的股指期货跨品种单向大边保证金制度，是指对沪深300股指期货、上证50股指期货和中证500股指期货的跨品种双向持仓，按照交易保证金单边较大者收取交易保证金。下面详细解释一下这个制度。

首先，涉及的股指期货包含三个品种：沪深300期指，上证50期指和中证500期指。所谓的跨品种，就是说持仓的品种可以是这三个品种里面的某两个，或三个。但是，需要是双向持仓，即部分做多，部分做空，这是前提条件。当投资者在三个品种中既持有多单，也持有空单时，不用每个单子都缴纳足额的保证金，而是看多单和空单中保证金较多的是哪方，就按照哪方缴纳保证金即可。这样的结果，就是投资者缴纳的保证金较小，也就是所需的成本降低了。这样对投资者是有利的，当然会受到投资者的欢迎。

那么，实行这样的制度，交易所的风险是否会增大呢？答案是不会，因为多空单子是可以互相抵消一部分风险的。只有金额较大的一方，才是真正的风险敞口。所以，交易所实行这样的制度，是根据客观情况制定的，是合情合理的。不过，结算程序上需要修改一下而已。

实际上，中金所此自2014年10月27日起已经对期指和国债期货实施了同品种单向大边保证金制度，在2015年7月10日对国债期货实施了跨品种单向大边保证金制度。本次的期指跨品种单向大边保证金制度，已经有了前面的实践经验，问题不大。

不过，无论如何，应该说，这样的制度是很细化的，对投资者来说非常贴心。从此也可以看出，交易所对投资者的服务真的是越做越细致，越做越好。

期货套利如何做？

我基本上不做套利，但是有一定的了解，今天，随意聊点。

我们的探讨维度是投机交易者如何做套利。

而非现货企业。

现货企业做套利的话，说起来就有点长了，而且关注我的人，我估计大多数都是做投机的。

按照教科书的说法，所谓的套利是指利用相关市场或者相关合约之间的价差变化，在相关市场或者相关合约上进行交易方向相反的交易，以期在价差发生有利变化而获利的交易行为。

比如，你买入螺纹钢1901，你卖出螺纹钢1905。这样的话，如果1901涨的猛，或者1905跌的凶，你就可以获利了。

对吧？

我们盈利的基础是什么？我们盈利的基础是，价差的波动。对吧？

传统思路觉得，价差总是应该在一个合理的区间内，超过了即为不合理，就存在价差回归的机会。也就是说，传统的思路觉得，我们做期货套利交易，应该做的是，趋势回归震荡。

比如下图：

我们假如这是两个合约的价差走势，正常情况，他们在一个“合理”的范围内波动，但是忽然有一天，价格上涨了，走出了一小波趋势。这个时候，就是不合理出现了，于是，很多人就倾向于去做空。

从行为上来看，大多数人理解的套利，应该是逆趋势的做法。但是，我给各位看个图：

我们就看这一段，这是焦煤1901和1905的价差走势图。

这不就是一个K线图吗？

如果在这个K线图上，做所谓的回归，我目测会亏的死去活来...

我曾经说过，天下K线是一家，只要是K线，其盈利的本质就是一样的。在这种走势上，做所谓的回归，我看是不行的。

因此，所谓的期货投机交易者做套利的话，我的建议是：

对着价差走势图，趋势跟踪，截断亏损，让利润奔跑。

欢迎吐槽，点赞支持一下，谢谢。

关于股指期货的无套利区间的内容到此结束，希望对大家有所帮助。