

老铁们，大家好，相信还有很多朋友对于国际金融和国际金融期货套期保值的相关问题不太懂，没关系，今天就由我来为大家分享分享国际金融以及国际金融期货套期保值的问题，文章篇幅可能偏长，希望可以帮助到大家，下面一起来看看吧！

本文目录

- [1. 股指期货市场中，如何利用股指期货做套期保值？](#)
- [2. 期货套期保值策略交易怎么样？](#)
- [3. 企业为什么要利用期货进行套期保值](#)
- [4. 中国金融期货交易所套期保值制度设计的原则是](#)

股指期货市场中，如何利用股指期货做套期保值？

计算出持有股票的市值总和，以到期月份的期货价格为依据算出进行套期保值所需的合约个数，在到期日同时实行平仓，并进行结算，实现套期保值。

期货套期保值策略交易怎么样？

套期保值（Hedging），又称避险、对冲。

广义上的套期保值，是指企业利用一个或者一个以上的工具进行交易，预期全部或部分对冲其生产经营中所面临的价格风险的方式。

套期保值交易选取的工具是比较广的，通常有期货、期权、远期、互换等衍生工具。

期货的套期保值是指企业通过持有与其现货市场头寸相反的期货合约，或将期货合约作为其现货市场未来要进行的交易的替代物，以其对冲价格风险的方式。

期货套期保值策略之所以能够起到风险对冲的作用，其根本原因在于：期货价格与现货价格受到相似的供求等因素影响，两者的变动趋势趋同，这样的话，通过套期保值，无论价格是涨是跌，总会出现一个市场盈利而另一个市场亏损的情形，盈亏相抵，就可以规避因为价格波动而给企业带来的风险，实现稳健经营。

那么要实现“风险对冲”，在套期保值操作中应满足以下条件：

- （一）在套期保值数量选择上，要使期货与现货市场的价值变动大体相当。
- （二）在期货头寸方向的选择上，应与现货头寸相反或作为现货未来交易的替代物

。

（三）期货头寸持有时间段与现货承担风险的时间相对应。

以上是我的答案支持一下点个关注！

企业为什么要利用期货进行套期保值

1、套期保值意义：全球金融危机以来，无论是国家高层还是国内企业，对利用期货市场进行套期保值的重视程度都越来越高，对套期保值为国民经济服务的要求也随之提高。

但是，由于我国期货市场尚处于发展的初期阶段，套期保值的功能发挥受到限制，导致企业在套期保值过程中对风险的把控能力不尽如人意，出现了不少套保亏损额度较大的案例。

2、按照传统的套期保值定义，套期保值是指投资者在期货交易中建立一个与现货交易方向相反、数量相等的交易部位。在一定的社会经济系统内，商品的期货价格和现货价格受相同因素的影响而呈现基本一致的价格走势，而在期货合约到期时因套利行为的存在，使得商品的期货价格和现货价格逐步收敛于一致，这就意味着可以用一个市场的利润来弥补另一个市场的损失。

3、原则理论上是完美的，但企业所面临的市场环境和经营环境是复杂多变的，若机械地依照此四项原则进行套保实践，将遭受重大挫折。以数量相等原则为例，很多企业完全照搬此原则，选择与实际现货头寸等量的期货合约进行套保，但是在具体时点上，期货与现货价格的波幅并不一致，而且会出现价差大幅拉大或缩小的现象，这就使得完全对等的套期保值效果大打折扣。

4、其实，从套期保值的利润熨平效应来看，企业保值的目的是不是规避所有的价格风险，而是将企业的利润曲线压缩到企业稳健经营可接受的程度，这意味着企业应该根据风险偏好灵活科学地选择风险敞口。同时，组合投资理论认为，交易者进行套期保值实际上是对现货市场和期货市场的资产进行组合投资，套期保值者根据组合投资的预期收益和预期收益的方差，确定现货市场和期货市场的交易头寸，以使收益风险最小化或者效用函数最大化。套期保值者在期货市场上保值的比例是可以选择的，最佳套期保值的比例取决于套期保值的交易目的以及现货市场和期货市场价格的相关性。此外，按照月份相同原则也会因没有对基差结构进行分析而面临流动性不足和基差变动的风险。

中国金融期货交易所套期保值制度设计的原则是

原则是：

第一条为发挥期货市场的套期保值功能，促进期货市场的规范发展，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条会员、客户在中国金融期货交易所（以下简称交易所）从事套期保值业务应当遵守本办法。

关于国际金融，国际金融期货套期保值的介绍到此结束，希望对大家有所帮助。