

老铁们，大家好，相信还有很多朋友对于钢材期货套期保值和钢材期货套期保值案例的相关问题不太懂，没关系，今天就由我来为大家分享分享钢材期货套期保值以及钢材期货套期保值案例的问题，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. [什么是套期保值](#)
2. [关于企业期货套期保值的书有哪些？](#)
3. [套期保值是什么意思？能解释得通俗易懂一些吗？](#)
4. [钢材买卖利润潜规则](#)

什么是套期保值

套期保值的目的

期货市场基本的经济功能之一就是为现货企业提供价格风险管理的机制。为了避免价格风险，最常用的手段便是套期保值。期货交易的主要目的是将生产者和用户的价格风险转移给投机者。当现货企业利用期货市场来抵消现货市场中价格的反向运动时，这个过程就叫套期保值。

套期保值(Hedging)又译作"对冲交易"或"海琴"等。它的基本做法就是买进或卖出与现货市场交易数量相当，但交易方向相反的商品期货合约，以期在未来某一时间通过卖出或买进相同的期货合约，对冲平仓，结清期货交易带来的盈利或亏损，以此来补偿或抵消现货市场价格变动所带来的实际价格风险或利益，使交易者的经济收益稳定在一定的水平。

套期保值的原理

第一，期货交易过程中期货价格与现货价格尽管变动幅度不会完全一致，但变动的趋势基本一致。即当特定商品的现货价格趋于上涨时，其期货价格也趋于上涨，反之亦然。这是因为期货市场与现货市场虽然是两个各自分开的不同市场，但对于特定的商品来说，其期货价格与现货价格主要的影响因素是相同的。这样，引起现货市场价格涨跌的因素，也同样会影响到期货市场价格同向的涨跌。套期保值者就可以通过在期货市场上做与现货市场相反的交易来达到保值的功能，使价格稳定在一个目标水平上。

第二，现货价格与期货价格不仅变动的趋势相同，而且，到合约期满时，两者将大

致相等或合二为一。这是因为，期货价格包含有储藏该商品直至交割日为止的一切费用，这样，远期期货价格要比近期期货价格高。当期货合约接近于交割日时，储存费用会逐渐减少乃至完全消失，这时，两个价格的决定因素实际上已经几乎相同了，交割月份的期货价格与现货价格趋于一致。这就是期货市场与现货市场的市场走势趋同性原理。

当然，期货市场并不等同于现货市场，它还会受一些其他因素的影响，因而，期货价格的波动时间与波动幅度不一定与现货价格完全一致，加之期货市场上有规定的交易单位，两个市场操作的数量往往不尽相等，这些就意味着套期保值者在冲销盈亏时，有可能获得额外的利润，也可能产生小额亏损。因此，我们在从事套期保值交易时，也要关注可能会影响套期保值效果的因素，如基差、质量标准差异、交易数量差异等，使套期保值交易能达到满意的效果，能为企业的生产经营提供有效的服务。

关于企业期货套期保值的书有哪些？

《期货服务实体经济案例集》，这本书很好，里面有60个企业期货套期保值的案例，几乎涵盖了所有的期货品种。

案例01：深化产融结合，服务黑色金属产业链

——国泰君安期货服务钢铁企业经验总结

案例02：构建多层次套保体系，促进企业稳健经营

——南钢股份期货市场套保操作历程及案例

案例03：巧用基差锁利润，借助期货防风险

——华信期货服务某原糖加工企业

案例04：防风险稳经营，期货护航促发展

——招金期货服务上市公司金晶科技

案例05：期现两手抓，国企在前行

——中钢期货服务某国有钢企

案例06：灵活运用套利思路，提升套期保值效果

——迈科期货服务镍行业企业

案例07：未雨绸缪，利用期货市场稳定企业经营

——上海中期期货服务兖矿煤化供销有限公司

案例08：期现结合，锁定利润

——中辉期货服务某钢铁企业

案例09：中小企业利用PTA期货度过行业寒冬

——东吴期货服务某塑料企业

案例10：“小”企业“全”定制，巧用期货避风险

——中州期货服务青岛昌盛化工

。。。。。。

列举的案例如上！

由于现代企业的生产经营周期较长，在采购、生产与销售其间不可避免将面临着难以控制的原料与产成品价格波动风险。虽然企业也可以与上下游企业通过签订远期合同来锁定价格，但远期合同存在谈判成本高、履约风险大等特点，尤其对于中小规模企业，在谈判时通常处于被动接受的不利地位。

期货市场为企业进行价格风险管理提供了便捷的工具，具有标准化、履约保证强、参与门槛低等特点。根据企业的经营特点，运用期货工具灵活地制定套期保值方案，将对企业的生产经营环境带来极大的改善。

中小规模企业参与期货市场进行套期保值的比例并不高，但他们对于价格风险认识不足，缺乏正确的套期保值观念，往往会以投机的心态参与期货市场，这样就会使其期货头寸失去现货的对冲保护，陷入与生产经营无关的不可控风险之中。一旦期货头寸亏损，企业往往会归罪于套期保值方法的失败，从而失去继续使用期货工具的愿望。

而实体企业的专长在于生产经营，对于价格风险缺乏相应的管理体制与人才储备。期货公司正好在价格波动方面有成熟的管理方案与人才资源，这就使实体企业有与期货公司合作的需求。

对于期货公司来说，有责任和义务去积极帮助实体企业充分利用期货工具来化解经营风险，实现稳定的增长，最终实现共赢。作为期货公司的营业部，直接面对客户，发现客户的需求，解决客户的问题是我们与客户达成合作关系的主要方法。

如您需要帮助，请评论交流！

套期保值是什么意思？能解释得通俗易懂一些吗？

我是板砖，主管企业套期保值工作十年，前来解答。先明确说一下观点，书本上的知识与实际工作中的应用还是有很大不同，习惯性的教条主义会让你的套保失去效果和意义。

套期保值，必须肯定的一点是基于现货基础之上，失去了现货的支撑，保值无从谈起。套期的期是周期、时间的意思，它是由现货的进出日期来决定期货操作的合约选取。保值的值是价值、货值的意思，它是随市场价格变动而变动的，保值的作用在于最大限度上规避价格波动带来的货值损失。

书本上保值讲究保值品种与保值对象品种相同或者相近，方向相反，数量相等，周期基本相同等原则，这是理论化的保值操作，现实中的保值远比这来的复杂。

企业实体进行保值时，会充分考虑既有存货的贬值风险和未来需求的成本上升风险。在做保值的策略和规划时会优先让这两块互相对冲掉，多余的部分才进行保值的操作。至于说合约的选择，保值的比例，头寸留存过程中移仓带来的点位差，现货变动过程中的基差，都需要做出详细的考虑和分析。

当然，每个企业有自己的保值制度和规划，对应不同的保值品种也会有自己的考虑。有想法的朋友可以留言交流，加关注私信板砖也可以的，互相学习，共同进步。

钢材买卖利润潜规则

钢材买卖利润的潜规则，钢材现货价格与期货价格呈同方向波动，就可以用钢材期货上的盈利来弥补现货上的风险，从而回避钢材现货价格波动带来的风险。

套期保值的基本原则：担心下跌保下跌、担心上涨保上涨。

好了，文章到这里就结束啦，如果本次分享的钢材期货套期保值和钢材期货套期保值案例问题对您有所帮助，还望关注下本站哦！