

很多朋友对于Wind股指期货当月连续合约和股指期货当月连续什么意思不太懂，今天就由小编来为大家分享，希望可以帮助到大家，下面一起来看看吧！

本文目录

1. [qeubee金融信息终端和wind区别](#)
2. [商品期货主力合约中，你觉得哪两个品种关联最强、走势最像？](#)
3. [股市下跌，为何没有公募基金用股指期货进行风险对冲，而是跟大盘一起跌下去？](#)
4. [为啥股指期货升水有利于做无风险收益？](#)

qeubee金融信息终端和wind区别

QEUBEE金融信息终端和Wind是两种金融信息服务和终端设备，它们有以下几点区别：

1. 提供商：QEUBEE金融信息终端是由QEUBEE公司提供的，而Wind是由Wind Information公司提供的。

2. 功能和内容：QEUBEE金融信息终端和Wind都提供金融市场数据、研究报告、实时行情、财经新闻等信息。然而，它们的具体功能和内容可能有所不同，包括数据范围、市场覆盖、分析工具等方面的差异。

3. 用户界面和易用性：QEUBEE金融信息终端和Wind在用户界面和交互方式上可能有所差异。这包括布局、图表、报表、搜索功能、个性化配置等方面的差异。每个终端都有其独特的特点和设计风格，适应不同用户群体和使用习惯。

4. 数据订阅与费用：使用QEUBEE金融信息终端和Wind通常需要订阅相应的数据服务，这些数据服务的费用和订阅方式可能有所不同。具体的订阅费用和合约规定需要向厂商咨询。

综上所述，QEUBEE金融信息终端和Wind在提供商、功能和内容、用户界面和费用等方面存在一些差异。选择适合自己使用需求和预算的金融信息终端，需要综合考虑这些因素，并与供应商进行详细的了解和比较。

商品期货主力合约中，你觉得哪两个品种关联最强、走势最像？

谢邀了。

这类问题没有什么确定的答案，因为品种的走势相关性都是不停的再变的。

很明显，每一个期货合约的背后，都是不相同的期货品种。它们的走势可能是上下游，可能是替代品。因此，走势一模一样不可能，但是，相似总是有的。

我觉得哪两个相似？

螺纹钢和热卷，豆粕和菜粕，焦炭和焦煤等等。

但是，本着授人以渔的想法，我来教题主两个方法看这类问题。

第一个，你打开文华财经WH6。

在你想要对比的品种K线上，右键单击--选择叠加参考合约。

你就可以选择你想要对比的两个期货合约好好研究一番了。比如，我把螺纹钢和热卷的数据叠加了，给你看看效果：

另外，如果你一定要严谨的分析，我记得向WIND那种软件里面直接有品种走势的相关度数据，它采用了算法，详细的计算了各个品种走势之间的相关性。

或者你自己导出K线的数据自己用算法来计算也可以。

点赞支持一下，谢谢。

股市下跌，为何没有公募基金用股指期货进行风险对冲，而是跟大盘一起跌下去？

我能说点不该说的吗？对冲个毛线啊。

就为了说股灾是有人恶意做空，某些人将期指给阉割了。是恶意做空吗？15年初有没有某些单位说话恶意做多？

现在的期指，一天就20手，只能对冲多少钱？随便找个基金，几十个20手都不够用，怎么对冲？已经是很明显了，现在的期指，根本就是一个瘫痪的状态，而一些曾经利用期指对冲的量化基金，现在的净值就是一条横线，根本就没有波动，说明都没有进场。

特别是最近几天的走势，中小创杀的差不多了，就开始杀基金杀私募，为了挤杠杆

，将市场里大量的带杠杆资金都挤了出来。这几天，周边的大资金哀嚎一片，没期指没期权没对冲，啥都没有，平都来不及，眼睁睁的看着跌。

所以说，不用想了，这市场根本没有任何的对冲手段，某些人也不希望有这种手段。总之就是跌怕了，觉得只要对冲就是做空，现在好，都停了，也不知道还有什么理由！

为啥股指期货升水有利于做无风险收益？

用沪深300ETF套取无风险收益

A股波动日益增加，单纯的博市场底部或者卖空的投资策略，风险日益凸显。那么，对于中等资产规模（约100万元）的投资者而言，有没有其他风险较小、收益率预期稳定的投资策略呢？

有的。比如，利用华泰柏瑞沪深300ETF和股指期货市场，可以进行一些对冲操作，有望套取一些无风险收益。

在此，我们先针对近阶段沪深300股指期货各合约频频出现升水的状况，介绍一个利用华泰柏瑞沪深300ETF（510300）作为期指现货组合，进行套利操作的方法。

由于华泰柏瑞沪深300ETF每30万份正好对应1张沪深300期指合约、流动性较好（目前日交易量在沪深交易所上市ETF一直稳居前2名），可以让投资者较以前更方便地套取到其中的无风险收益。

以2012年7月27日下午盘中(13:34)期指情况为例，当日IF1208、IF1209、IF1212、IF1303全线出现升水，基差从21.04到94.24不等。如下图截屏：

数据来源：WIND统计时间：2012年7月27日13:34

2012年7月27日下午13:34，华泰柏瑞沪深300ETF二级市场价格2.378元每份。如下图截屏：

数据来源：WIND统计时间：2012年7月27日13:34

我们以其中最快到期的IF1208合约为例，投资者投入82万元左右，进行期现套利，年化收益率预计在12%以上。计算过程如下：

假设1：华泰柏瑞沪深300ETF买入佣金0.05%，期指合约买入佣金0.02%，期指合

约卖出佣金0.02%，华泰柏瑞沪深300ETF卖出佣金0.05%；300ETF和期货合约买卖冲击成本0.1%，合计成本0.24%，ETF买卖无印花税；

假设2：沪深300指数成份股在IF1208合约到期之前期间分红对指数的影响为0.187%（数据来源：东方证券《2012年7月26日沪深300指数期货专题研究——成分股分红进行时系列十八》报告）；

假设3：华泰柏瑞沪深300ETF的折溢价率在买入和卖出时点保持一致；

假设4：股指期货合约的保证金比例为15%（即假设期货公司对客户收取保证金比例上浮3%）。

操作方式：

第一步：二级市场买入30万份华泰柏瑞沪深300ETF（代码：510300），同时卖空1张沪深300期指合约；

第二步：上述操作直至IF1208到期日（2012年8月17日）在期货基差收敛为0时进行反向操作，即卖出华泰柏瑞沪深300ETF和平仓沪深300期指合约。

得：

（1）IF1208合约升水率=IF1208合约基差/沪深300指数=21.04/2343.36=0.898%

（2）扣除成本并考虑分红后的有效升水率=IF1208合约升水-交易成本+成份股分红影响=0.898%-0.24%+0.187%=0.845%

（3）期现套利收益=30万份华泰柏瑞沪深300ETF*扣除成本并考虑分红后的有效升水率=30万份*2.378元/份*0.845%=6028.23（元）

（4）投入资金=30万份华泰柏瑞沪深300ETF+卖空1张期指合约=（30万份*2.378元/份）+2364.40*300*15%=819,798（元）（备注：期货合约每点价值300元，保证金为15%）

（5）期间收益率=期现套利收益/投入资金=6028.23元/819,798元=0.73%（期间是指7月27日至8月17日，共21天）

（6）折合年化收益率≈期间收益率*（365天/21天）=0.73%*（365/21）=12.7%

%

值得指出的是，上述操作是假设IF1208合约基差在该合约存续期间一直未收敛，直到合约到期日才收敛后，方进行第二步反向操作。如果在进行第一步开仓操作之后，IF1208合约基差在较短时间内（该合约到期日之前）迅速收敛，则我们即可卖出华泰柏瑞沪深300ETF，同时平仓卖空的IF1208，更快地获得上述期现套利无风险收益，折合年化收益率将高于前述水平。

如果IF1208合约基差预计在当日收敛，则投资者还可以利用华泰柏瑞沪深300ETF具有的“T+0”功能与期货合约的“T+0”交易无缝对接，日内获得上述期现套利无风险收益。上述两个操作步骤可以优化为：

第一步：买入一篮子300指数沪市成分股加上部分现金申购90万份华泰柏瑞沪深300ETF，同时卖空3张沪深300期指合约。（备注：华泰柏瑞沪深300ETF最小申购单位须为90万份极其整数倍）

第二步：在当天期货基差收敛为0时进行反向操作，即卖出当天申购的华泰柏瑞沪深300ETF和平仓沪深300期指合约。

此外，需要提醒投资者的是，投资人需要额外准备一定的股指期货持仓保证金，以防在日后沪深300指数上涨时，需要继续持仓的情况下，补充期货合约保证金，维持一定的保证金水平。

关于Wind股指期货当月连续合约到此分享完毕，希望能帮助到您。