

各位老铁们好，相信很多人对美股套利交易必读都不是特别的了解，因此呢，今天就来为大家分享下关于美股套利交易必读以及套利交易对期货市场的作用的问题知识，还希望可以帮助大家，解决大家的一些困惑，下面一起来看看吧！

本文目录

1. [美式期权的平价公式](#)
2. [如何利用etf基金在股市中套利](#)

一、美式期权的平价公式

$C + Ke^{-rT} = P + S_0$ 平价公式是根据无套利原则推导出来的。构造两个投资组合。

1、看涨期权C，行权价K，距离到期时间T。现金账户 Ke^{-rT} ，利率r，期权到期时恰好变成K。

2、看跌期权P，行权价K，距离到期时间T。标的物股票，现价 S_0 。看到期时这两个投资组合的情况。1、股价 S_t 大于K：投资组合1，行使看涨期权C，花掉现金账户K，买入标的物股票，股价为 S_t 。投资组合2，放弃行使看跌期权，持有股票，股价为 S_t 。2、股价 S_t 小于K：投资组合1，放弃行使看涨期权，持有现金K。投资组合2，行使看跌期权，卖出标的物股票，得到现金K。3、股价等于K：两个期权都不行权，投资组合1现金K，投资组合2股票价格等于K。从上面的讨论我们可以看到，无论股价如何变化，到期时两个投资组合的价值一定相等，所以他们的现值也一定相等。根据无套利原则，两个价值相等的投资组合价格一定相等。所以我们可以得到 $C + Ke^{-rT} = P + S_0$ 。

二、如何利用etf基金在股市中套利

可以分为单市场ETF、跨市场ETF、跨境ETF、货币ETF、债券ETF和黄金ETF。

拿着你的有效身份证和活期账户（比如工行借记卡，有结算功能，能银证转账），到证券营业部开设沪、深两地股东账号和资金账户。

其次，在券商营业部，同时开通基金交易权限。

第三，没有第三，现在你可以象买卖股票一样进行ETF基金交易了。

选择图示这个位置，在右侧（各个券商交易界面有所不同）输入ETF基金代码，点

击确定，就完成交易了。

1、T+1，也就是今天买入，只能明天卖出。

4、卖出（赎回）后，现金回到资金账户。

5、实现全球投资，但A股场内ETF做不到这一点，港股和美股ETF可以。

如果在好买基金网之类网上申购，称为场外交易。

特点是T+0，但资金门槛高，基本都是机构的天下，散户很少。

场外交易，赎回时，变成ETF基金对应的一篮子股票，再加现金，属于跨市场操作。

如果配合股指期货，机构可以通过ETF场外交易，实现跨市场套利。

若在场内购买上证50ETF基金，因个人买卖有0.3%交易费用，且单笔最低5元，所以每次买卖金额不应低于2000元，相对费率低，比较划算。

买ETF基金，最直接的好处是免去选股麻烦和“踩雷”风险。

看准指数跌宕起伏方向，买入后持有，到心理获利价位，平仓了结。

也就是说，你要做的，只需判断指数涨跌，决定买和卖，不必为挑选个股费心思。

以上证50ETF作为核心持股为例，可确保投资回报与大盘联动，不会错失大盘上涨机会。

这就是购买ETF基金的好处，这种交易方式，符合趋势投资型。

“金粉世家”的同学们，特喜欢定投，那就可以在基金网或基金类APP上，每周定投ETF联接基金，这种基金，对应的是场内相关主题ETF基金，等于投资ETF基金。

1、定投策略。定投ETF，手续费远低于定投基金，可说成本极低，爽不？

2、抓热点策略。300ETF和500ETF分别对应大盘股和中小盘。

A股市场常出现二八分化现象，有时大盘股涨，有时小盘股飙。

在每周五收盘前，可以看下300ETF和500ETF近一个月的涨幅，哪个涨幅大就买哪个，涨幅都为负则空仓。

这做法的特点在于，胜率虽然不高，但抓住一次大涨幅，就能覆盖前面小亏损，类似于程序化交易。

看到曙光了吧？懒人、理财小白，也有自己的春天。

好了，文章到这里就结束啦，如果本次分享的美股套利交易必读和套利交易对期货市场的作用问题对您有所帮助，还望关注下本站哦！