

怎么算股票仓位呢_如何准确判断股市庄家的仓位-股识吧

一、请问：什么是“仓位”？怎么计算仓位的比例？

所谓的仓位是针对你所持有的偏股基金与你所持有的货币型基金和准备投资基金的现金之和之间的比例。

也就是股基/投资总额，就是你的仓位。

仓位是指投资人实际投资和实有投资资金的比例。

比如你有10万用于投资基金，现用了4万元买基金或股票，你的仓位是40%。

如你全买了基金或股票，你就满仓了。

如你全部赎回基金卖出股票，你就空仓了。

如果目前市场比较危险，随时可能跌，那么就不应该满仓，因为万一市场跌了，你卖期货可能亏，但是你也没有钱买期货，就很被动。

通常，在市场比较危险的时候，就应该半仓或者更低的仓位。

这样，万一市场大跌，你发现你持有的期货跌到了很低的价位，你可以买进来，等它涨的时候，你把你原来的卖掉，就可以赚一个差价。

一般来说，平时仓位都应该保持在半仓状态，就是说，留有后备军，以防不测。

只有在市场非常好的时候，可以短时间的满仓。

二、怎样计算基金仓位

一、股票市值与净值之比——含有增值额的仓位以前通用的仓位是基金每季公布的股票市值与净值之比。

这种算法有一个问题是：股票市值及净值中含估值增值部分，即股价增长数额，并不代表基金在股价增长之前投入的实际资金。

估值增值部分的计入，虚增了基金投入股市的资金，也加大了投资前的资金量，是不太科学的。

股票市值与基金净值之比并不能准确地表示基金的仓位。

二、股票成本与扣除估值增值后的净值之比这个概念中，股票以成本计，净值也扣除了估值增值部分。

这个算法等于股票成本与股票成本及可用流动资金之比所计算出的仓位，其包含的真实意思有：基金短期内可动用的资金也包括在内(银行存款加各项应收款与应付款之差)，反映的是基金可支配的总体资金状况。

这应该是较为准确全面的仓位计算方法。

三、股票成本与股票债券成本及银行存款之比这种仓位可以说是狭义的仓位，是公告日基金已投资入市的股票成本与股票债券成本及银行存款之比。

也就是说，某时点，基金未投入股市的资金仅限于银行存款，而不包括应收应付净额。

由于季度投资组合公告没有估值增值数据，所以，后两种股票仓位的算法只能在基金公布中报年报后方能计算。

三、如何看股票型基金仓位

如何看待股票型基金仓位?基金仓位的意思是基金投入股市的资金占基金所能运用的资产的比例。

下限就是最低的比例。

投入股市的资金如何计算：是股票成本或是股票市值？基金所能运用的资产是净资产还是现金以前通用的仓位是基金每季公布的股票市值与净值之比。

这种算法有一个问题是：股票市值及净值中含估值增值部分，即股价增长数额，并不代表基金在股价增长之前投入的实际资金。

估值增值部分的计入，虚增了基金投入股市的资金，也加大了投资前的资金量，是不太科学的。

股票市值与基金净值之比并不能准确地表示基金的仓位。

股票成本与扣除估值增值后的净值之比是比较准确的。

这个概念中，股票以成本计，净值也扣除了估值增值部分。

这个算法等于股票成本与股票成本及可用流动资金之比所计算出的仓位，其包含的真实意思有：基金短期内可动用的资金也包括在内(银行存款加各项应收款与应付款之差)，反映的是基金可支配的总体资金状况。

这应该是较为准确全面的仓位计算方法。

目前股票型基金按照证监会的要求最低不能低于80%的股票仓位，所以在目前股市单边上涨行情中，股票型基金的基金净值上升是较多的。

因为必须保持60以上的股票仓位。

而混合型基金就相对灵活一些，可以在债券和股票中来回转换仓位。

与此同时，下跌时混合型基金风险也相对较小一些。

基金仓位测算方法有哪些？ $\text{基金收益率} = \text{基金BETA} * \text{市场收益率} + \text{alpha}$

用多日数据可以拟合出BETA和alpha。

然后根据Beta就可以知道基金的仓位变化了。

一、直接用比例来做。

用基金涨跌幅度比上指数的涨跌幅度。

简单易行，粗糙。

二、用回归来做。

基本原理就是 $P=aX+bY+cZ$ ， P 是基金的净值， X, Y, Z 选择的是不同的指数来回归，但不限于三个。

最后用回归来确定 a, b, c 的值，合起来就是基金的仓位。

后来对于基金仓位预测的分歧主要集中在 X, Y, Z 的选择上，一些研究报告里面所谓的第二代第三代模型就是这点区别，本质都是回归，用excel下个叫megastat的插件都能做。

所谓第二代就是 X, Y, Z 选的是大盘股、中盘股、小盘股等指数，第三代则为不同行业的指数，医药、银行、房地产等。

问题是：1、选择大盘股、中盘股、小盘股等指标(当然可以是别的，也可以用A股，创业板，中小板)，做出的回归实际投资指导意义不大。

2、所以很多模型选择用行业指数来进行回归，常见的就是中证、申万的行业指数，网上可以下到。

3、回归类的模型要考虑两个问题，首先，基金并不是全部投资股票的，会投资债券等，但是当一只基金投资债券时，它的仓位预测出来就可能很低，而政府对于基金有最低仓位要求的，不符合实际，所以再选择基金类型上有甄别，或者要做出相应的调整。

其次，回归使用的指数一般会有非常强的多重共线性(就是这些指数一起涨一起跌，很难分辨基金买了哪类股票)，需要对多重共线进行处理，目前能使用的方法主要由差分法、岭回归、主成分提取。

岭回归我还没试过，差分法效果不显著，主成分提取还不错，但是也有很大的缺陷。

更多使用的方法还是主成分分析法，虽然在分行业的仓位计算有缺陷，但是基金的总体仓位预测误差不大，所录的基金仓位最高为85%左右，最低60%左右，基本和能看到的报道、法规一致。

四、如何计算自己股票的仓位

仓位是指投资人实有投资和实际投资资金的比例。

列举个例子：比如你有10万用于投资，现用了4万元买基金或股票，你的仓位是40%。

如你全买了基金或股票，你就满仓了。

如你全部赎回基金卖出股票，你就空仓了。

能根据市场的变化来控制自己的仓位，是炒股非常重要的一个能力，如果不会控制仓位，就像打仗没有后备部队一样，会很被动。

股票出仓面临着几种情况：1：在限定（非限定）的时间里完成所预计的利润；

- 2：在限定的时间里没有完成预计的利润；
- 3：在限定的时间里产生低于平仓线要求内的亏损；
- 4：在限定（非限定）的时间内超额完成计划的利润额度；
- 5：限定时间内，没有完成利润额度，但无亏损情况等。

五、股票型基金股票仓位最低60%，请问这个仓位是如何计算的？如果股票跌了，那就不到60%，是否要补仓？

基金股票仓位最低60%：60%不是计算的，是有关基金监管部门规定的，最少持有基金最少持有不同类型的股票60%，即使大盘下跌也不许卖出，可是（基金）可以换股。

就造成的一种现象大盘下跌时，有的股票先跌，有的抗跌，先跌的跌完了，基金可以把抗跌的卖了，换成跌完了的，抗跌的就补跌了，很好理解。

如果股票跌了，那就不到60%，是否要补仓？不用补仓，仓位：股票成本与扣除估值增值后的净值之比，即使股票上涨下跌，基金持有的成本是不变的，持有股票扣除的估值增值贬值后的（净价值）是不变的，股票上涨下跌对基金持有仓位没有影响。

六、如何准确判断股市庄家的仓位

当周K线图的均线系统呈多头排列时，就可以证明该股有庄家介入。

只有在庄家大量资金介入时，个股的成交量才会在低位持续放大，这是庄家建仓的特征。

正因为筹码的供不应求，使股价逐步上升，才使周K线的均线系统呈多头排列。

无论是短线、中线还是长线庄家，其控盘程度最少都应在20%以上，只有控盘达到20%的股票才做得起来，少于20%除非大市极好，否则是做不了庄的。

如果控盘在20% - 40%之间，股性最活，但浮筹较多，上涨空间较小，拉升难度较高；

如果控盘量在40% - 60%之间，这只股票的活跃程度更好，空间更大，这个程度就达到了相对控盘；

若超过60%的控盘量，则活跃程度较差，但空间巨大，这就是绝对控盘，大黑马大多产生在这种控盘区。

希望能够帮到你，祝您投资成功。

如果有其他股市方面的问题，请关注我的同名微博。

七、如何计算自己股票的仓位

对于持仓量的算法，国内是按你理解的方法计算的，持仓量的增加代表资金流入...
准确的说，股票市场中叫仓位，期货市场才有持仓量这一说！你说的意思应该是...

八、怎么准确计算股票持仓量？

对于持仓量的算法，国内是按你理解的方法计算的，持仓量的增加代表资金流入...
准确的说，股票市场中叫仓位，期货市场才有持仓量这一说！你说的意思应该是...

九、股票里的几层仓位是怎么算的？怎么乘除？

一般是用你的买入金额除以你的总资产，但也要随时根据持股市值的涨跌做调整。
比如你十万空仓，买入三万就是三成仓位。
如果后期这三万股票涨到五万了，你要清楚其实你现在是5/12，是四成多的仓位，
这对于仓位控制严格的人来说尤其重要，不要认为你是三万买进的还是三成仓位。
这样有利于你根据行情实时加减仓位。

参考文档

[下载：怎么算股票仓位呢.pdf](#)

[《股票锁仓后时间是多久》](#)

[《股票需要多久出舱》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《股票腰斩后多久回本》](#)

[下载：怎么算股票仓位呢.doc](#)

[更多关于《怎么算股票仓位呢》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/store/22680606.html>