

# 如何查看基金经理操作股票仓位—基金仓位哪里查-股识吧

## 一、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？基金收益率=基金BETA\*市场收益率+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。

## 二、基金公司仓位数据在哪里可以查到？

1、基金公司仓位数据查询在各大基金公司的官网上面的基金的持仓情况里面都可以查询到。

2、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。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?这两个指标的不同理解，将构造出不同的仓位数值。

## 三、用什么软件可以查看基金仓位？

有两大类基金。

1. 指数基金是可以看到仓位的，其实也不用看，因为指数基金的目标是跟踪指数涨

跌，所以它所投资的股票就是一个指数的成分股，并且这些股票还需要有不同的权重配置。

只要查询该指数成分股就知道该基金的仓位了，指数型基金为了跟踪指数，所以总体仓位都会很高，达到90-95%<sup>2</sup>。非指数型基金无法查看基金仓位。

基金季报一年四次，也都是仅仅公告10大重仓股，而且公告的日期已经是在一个季度结束后的20天了，而基金是可以随时调仓换股的，也就是说季报中显示的很可能已经不是目前的状态了也没有软件可以看到基金仓位，本身这个事就是不合规的，公募基金的信息披露基本都在季报中。

平时随便披露不合要求，会损害投资者利益。

## 四、如何查看当前的基金仓位情况

一般这个数据是一个季度公布一次，但一些专业研究机构会根据模型时时发布这个数据，这个都是内部报告，我一般从金蟾基金网的基金仓位查询频道看这个数据，还可以，每天都更新。

## 五、哪个网站里能查看到基金持仓的股票？

1. 我给楼主列举四个正规的披露网站。

2. 分别是：天天基金网、好买基金网、爱基金、私募排排网。

3. 天天基金网：[\\*1234567\\*.cn](http://*1234567*.cn)；

是首批获牌的第三方基金销售机构，中国最大的基金理财平台。

东方财富网旗下子公司。

4. 好买基金网：[\\*://\\*howbuy\\*](http://*://*howbuy*)；

好买财富，专业第三方财富管理机构，持中国证监会颁发基金销售牌照。

提供公募基金、私募基金、固收产品、私募股权PE/VC、新三板基金、债券、海外基金等4000余款理财产品，为您量身定制资产配置方案。

更有专业基金导购软件掌上基金和随身理财APP储蓄罐，让您轻松理财。

5. 爱基金网：[\\*://fund.10jqka\\*.cn](http://*://fund.10jqka*.cn)；

&nbsp;；

同花顺旗下一站式基金投资平台，轻松找到最适合您的基金。

并为您提供基金净值查询、投资收益计算、基金定投、基金网上交易等多种专业、及时的服务。

6. 私募排排网：[\\* : // \\*simuwang\\*](http://*simuwang*) &nbsp; ;  
&nbsp; ;

私募排排网是国内专业的阳光私募基金信息提供商、私募基金评级及私募基金销售服务商。

私募排排网数据频道为您提供最新的私募基金净值、私募基金排名，最全的私募基金

## 六、基金仓位哪里查

基金仓位你可以在买基金的那家银行的网上银行，进入自己的账户可以查到自己的基金账户具体仓位。

如果是在基金公司买的，直接上基金公司网站，进入自己的账户可以查到。

## 参考文档

[下载：如何查看基金经理操作股票仓位.pdf](#)

[《股票卖出多久继续买进》](#)

[《股票开户最快多久能到账》](#)

[《股票st到摘帽需要多久》](#)

[《股票一般多久一次卖出》](#)

[下载：如何查看基金经理操作股票仓位.doc](#)

[更多关于《如何查看基金经理操作股票仓位》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/33115915.html>