

股票仓位如何看 - 如何准确判断股市庄家的仓位-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、股票中仓位怎么划分最合理。

炒股控制仓位的技巧: 股票的价格是波动的, 相应的仓位也应该随之波动。

对于以天为单位的短线操作来说, 仓位在一天之内变化的平均值称为平均仓位, 相对于平均值的变化称为仓位波动。

合适的仓位和股票的走势, 股票的特性, 止损策略, 买入点的时机有关系。

股票以天为单位的走势大致分为三种: 横盘、上涨和下跌。

当股票在横盘时, 意味着上涨和下跌都有可能。

平均仓位大致可以为50%。

如果股票上涨, 可以酌情增加平均仓位, 上涨越明显, 平均仓位越高。

当股票下跌时, 要酌情减少平均仓位, 下跌越厉害, 仓位越低。

每只股票的特性都是不一样的。

同样是上涨, 有的涨的快, 有的涨的慢;

有的波动大, 有的波动小。

波动大、股性活跃的股票, 在K线图上, 相邻两天的价格重叠比较多, 无论是上涨还是下跌, 都有做短线的机会, 仓位波动可以大一些。

反之，如果股性不活跃，波动小，没有做短线的机会，那么在上涨时，可以锁住仓位不动，或逐步增仓，而在下跌时应该坚决空仓。

仓位和止损策略 做股票，一定要有风险意识，要有自己的止损策略，并把止损策略当作控制仓位的一个重要因素。

例如做短线，你可以把止损位定为全部资本的2%。

现在大盘一路下跌，势头开始减弱，同时个股开始横盘，在某个价位表现出抗跌性，你打算抄底买入。

你还考虑到这个股的庄家很霸道，如果明天大盘还是走弱，根据经验该股也有可能明天继续下砸5%，这时候买入仓位应该控制在40%(5% * 40% = 2%)左右。

仓位和买入时机：中国的股市实行T+1交易制度（中间也曾出现过A股T+0），买入的股票不能在当天卖出，但卖出后可以当天买入。

这意味着上午买入的股票要承担更大风险。

有时候，上午走势是一路上升，到下午很可能风云突变，掉头往下。

我们在控制仓位时，要充分考虑到这一点。

上午即时出现了好的买入时机，也要额外降低仓位；

而下午出现买入时机时，可以适当增加仓位。

上午出现卖出时机时，要坚决减仓，因为你如果实在看好这支股票，后面还有低位买入的机会。

由上面的分析可以看出，仓位控制是一个动态的持续的过程，需要随时根据大盘和个股的走势调整仓位。

这样做肯定很累，但却可以有效地控制风险，实现稳定地盈利。

三、票中的仓位是什么？如何计算？

简单地讲仓位就是你持有的股票的市值占你的总资金的比例比如你有一万元，买了5000元股票，那你的仓位是50%股票的成本价就是你所有股票的买进价格和应交纳的手续费之和。

成交价就是你买卖股票时的价格

四、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。

五、老听说别人问仓位 仓位是怎么区分的 轻仓 重仓

仓位也即你持有股票价值在你的资产总额中所占的比例。比如你有10万总资产，买了股票3万，你的仓位为30%，算是属于轻仓；买了7、8万股票，是重仓；全买成了股票10万，就是满仓了。

????

- [?????????.pdf](#)
- [????????????](#)
- [????????](#)
- [?????????.doc](#)
- [??????????????...](#)

??
<https://www.gupiaozhishiba.com/subject/36056737.html>