

股票市场监管日报

报告日期：2025-03-27

1. 市场指数表现

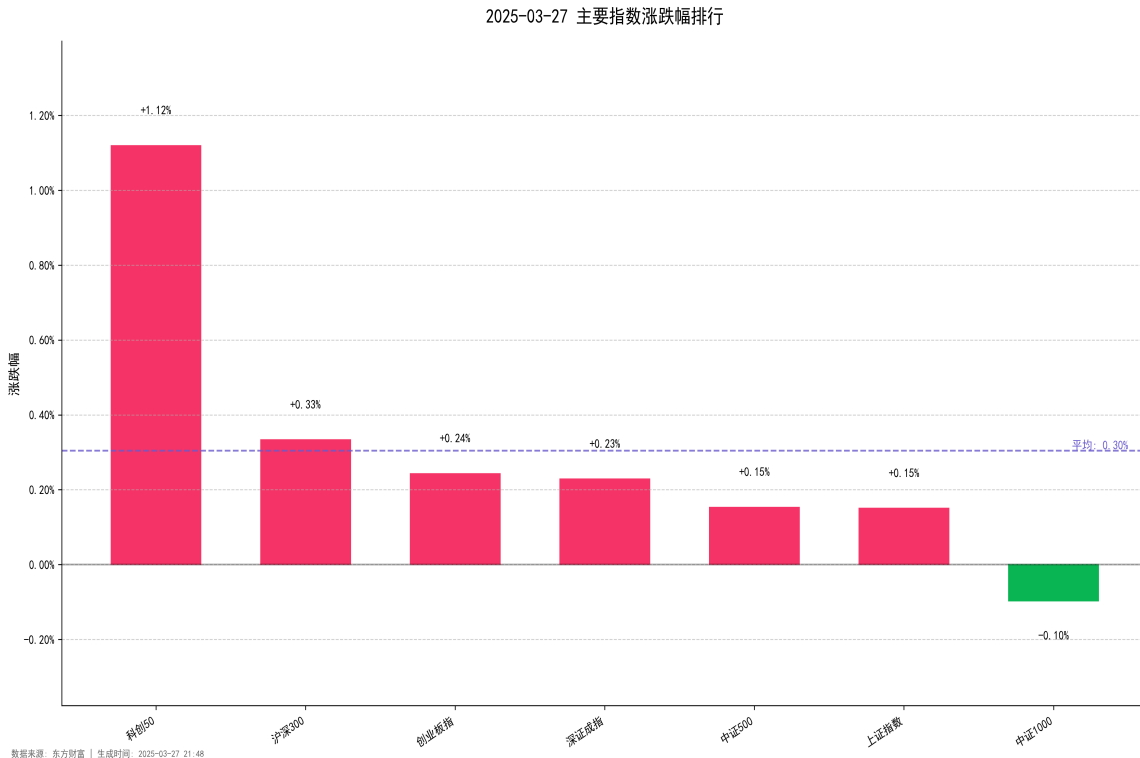


图1: 主要市场指数涨跌幅对比

2. 行业资金流向分析

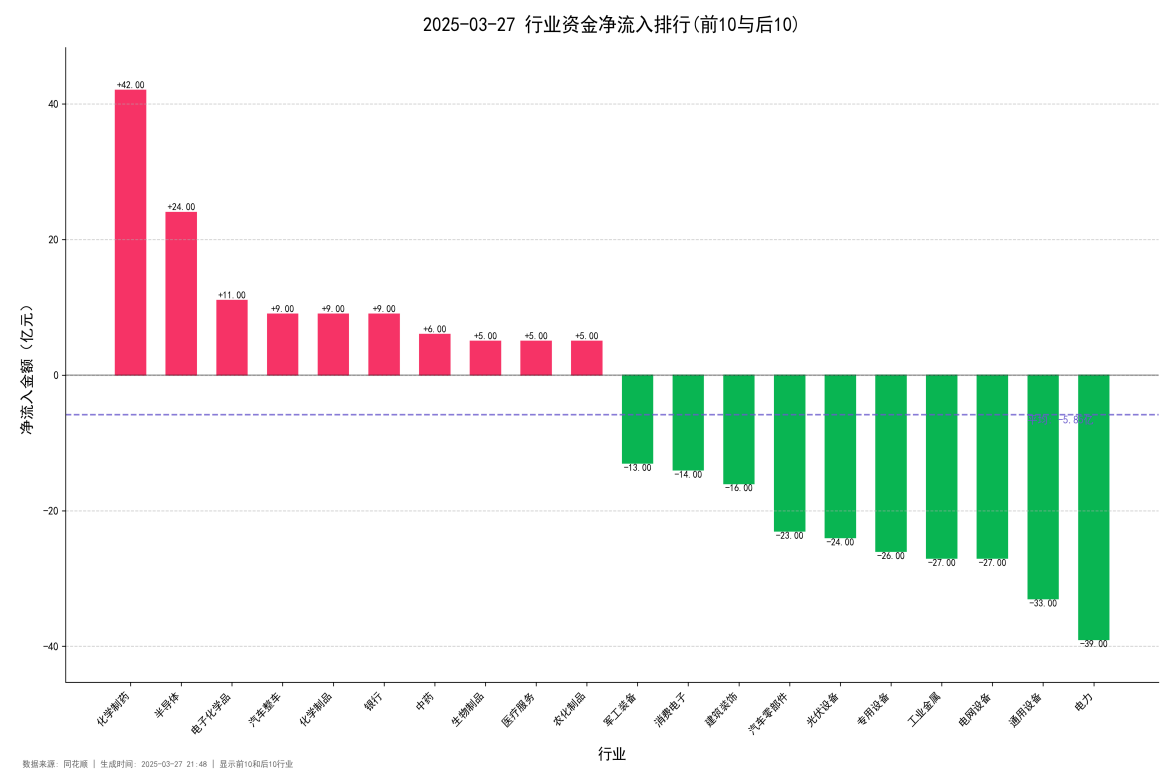


图2: 行业资金流向排行榜 (净流入/净流出前十)

3. 全市场个股资金净流入排行

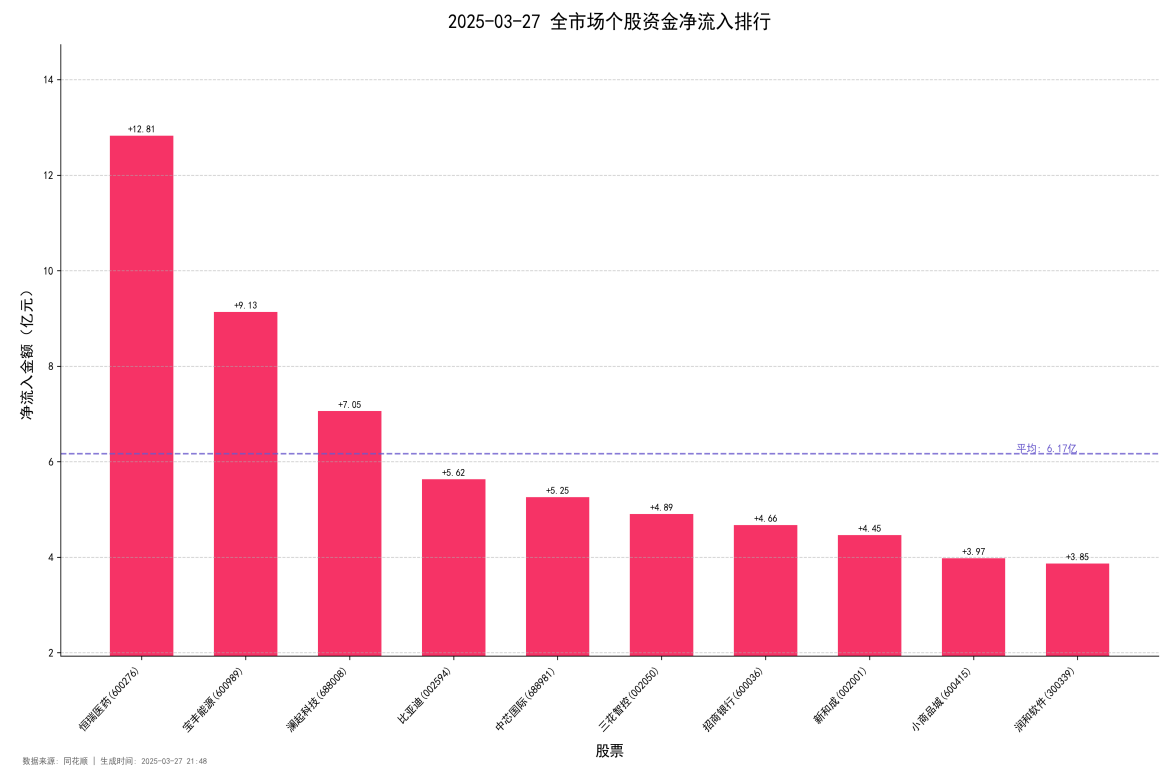


图3: 全市场个股资金净流入金额排行榜（前十名）

4. 量价背离指数分析

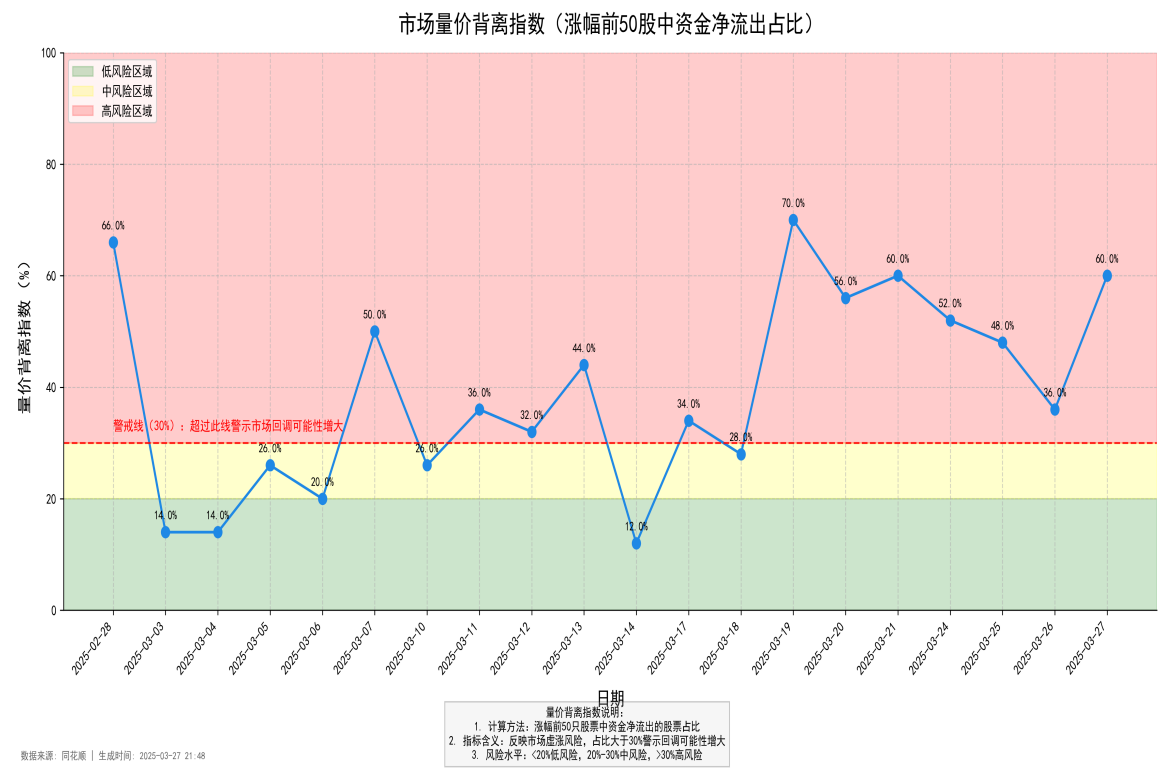


图5: 量价背离指数历史走势（过去20个交易日）

说明: 该指数计算涨幅前50但资金净流出的个股占比，反映市场虚涨风险。指数超过30%时警示市场可能回调。

5. 资金集中度指标分析

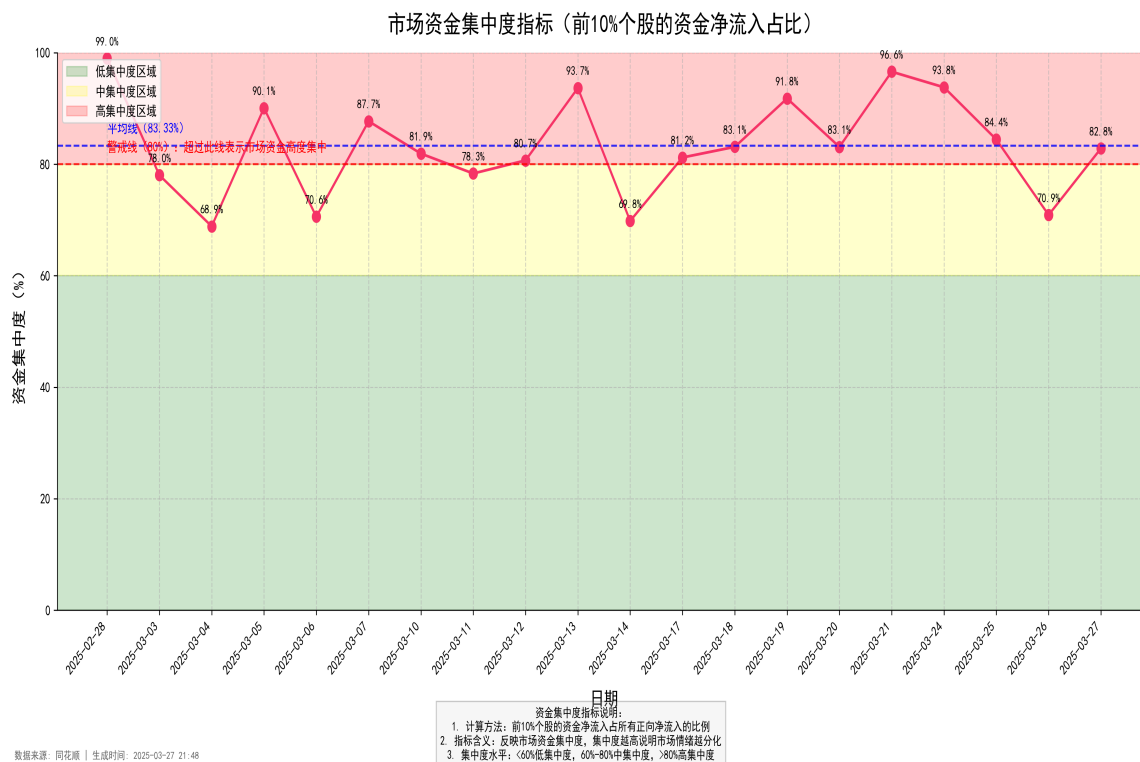


图6: 资金集中度指标历史走势（过去20个交易日）

说明: 该指标计算前10%个股的资金净流入占全市场比例，反映市场资金分散/集中程度。集中度越高说明市场情绪越分化，热点集中。

6. 上涨/下跌股票比值分析

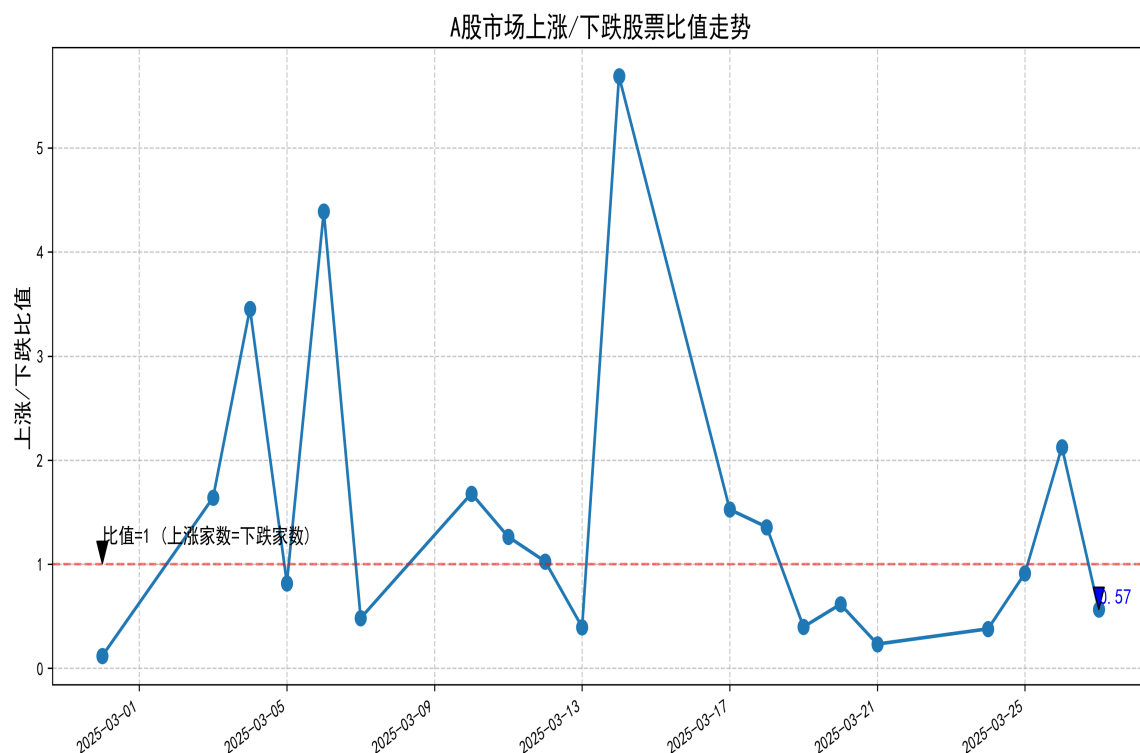


图7: 上涨/下跌股票比值历史走势 (过去20个交易日)

说明: 该指标计算市场上涨股票数与下跌股票数的比值。

比值小于1表示下跌家数多于上涨家数, 市场整体偏弱。

比值大于2表示上涨家数远多于下跌家数, 可能处于强势上涨中。

7. 技术指标分析

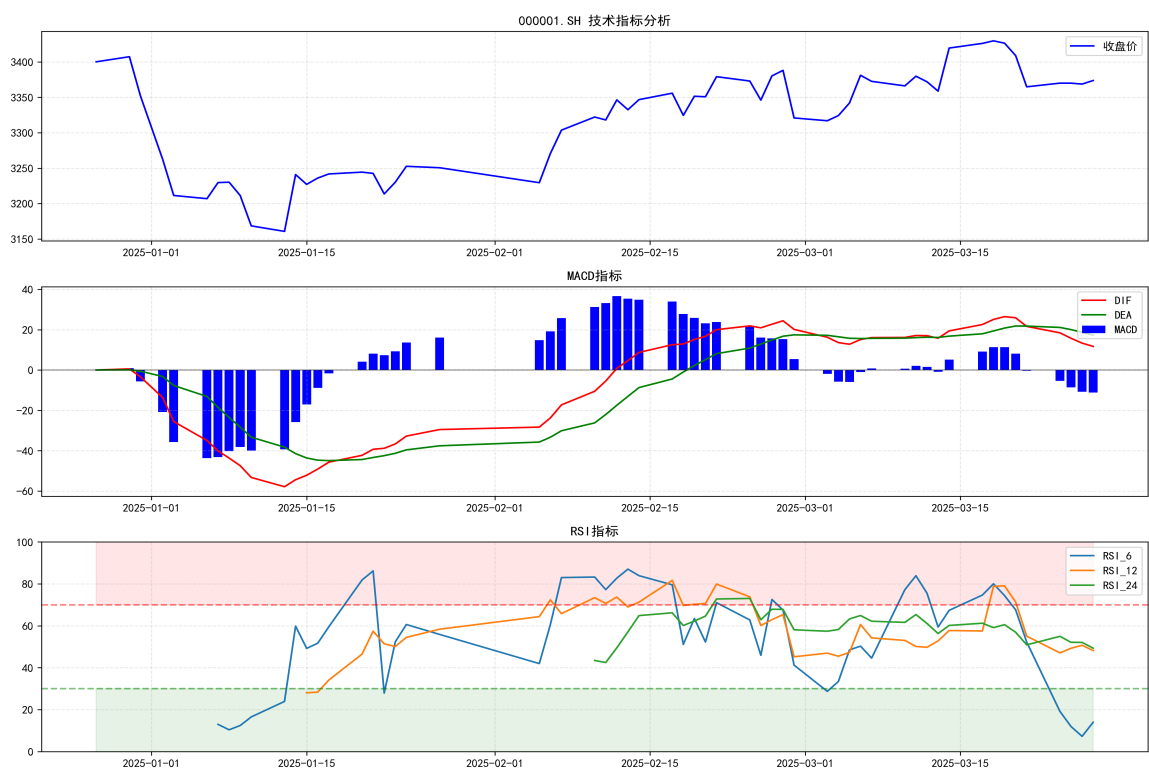


图8: 上证指数技术指标分析 (MACD、RSI)

说明: MACD指标通过快慢均线的交叉判断趋势变化, RSI指标显示超买超卖信号。两者结合可预测潜在的市场顶部和底部。

8. 市场监测结论

基于以上分析, 我们对当前市场状况得出以下结论: 1. 大盘指数表现: 关注沪深300、上证指数的强弱变化, 以及创业板、科创板的表现差异。 2. 行业资金流向: 识别主导市场方向的强势行业, 特别关注连续获得资金流入的行业。 3. 个股资金流向: 重点关注大额资金净流入的个股, 它们往往代表着市场的主流方向。 4. 量价背离指数: 警惕虚假上涨行情, 当价格上涨但资金流出时, 增加风险控制。 5. 资金集中度: 评估市场是否存在明显热点, 集中度过高时注意热点轮动风险。 6. 上涨/下跌比例: 全面了解市场整体强弱, 作为重要的市场宽度指标。 7. 技术指标: 通过MACD和RSI判断市场顶底, 指导短期交易决策。 综合判断: 通过以上七个维度的综合分析, 形成对市场的整体研判, 指导投资决策。