

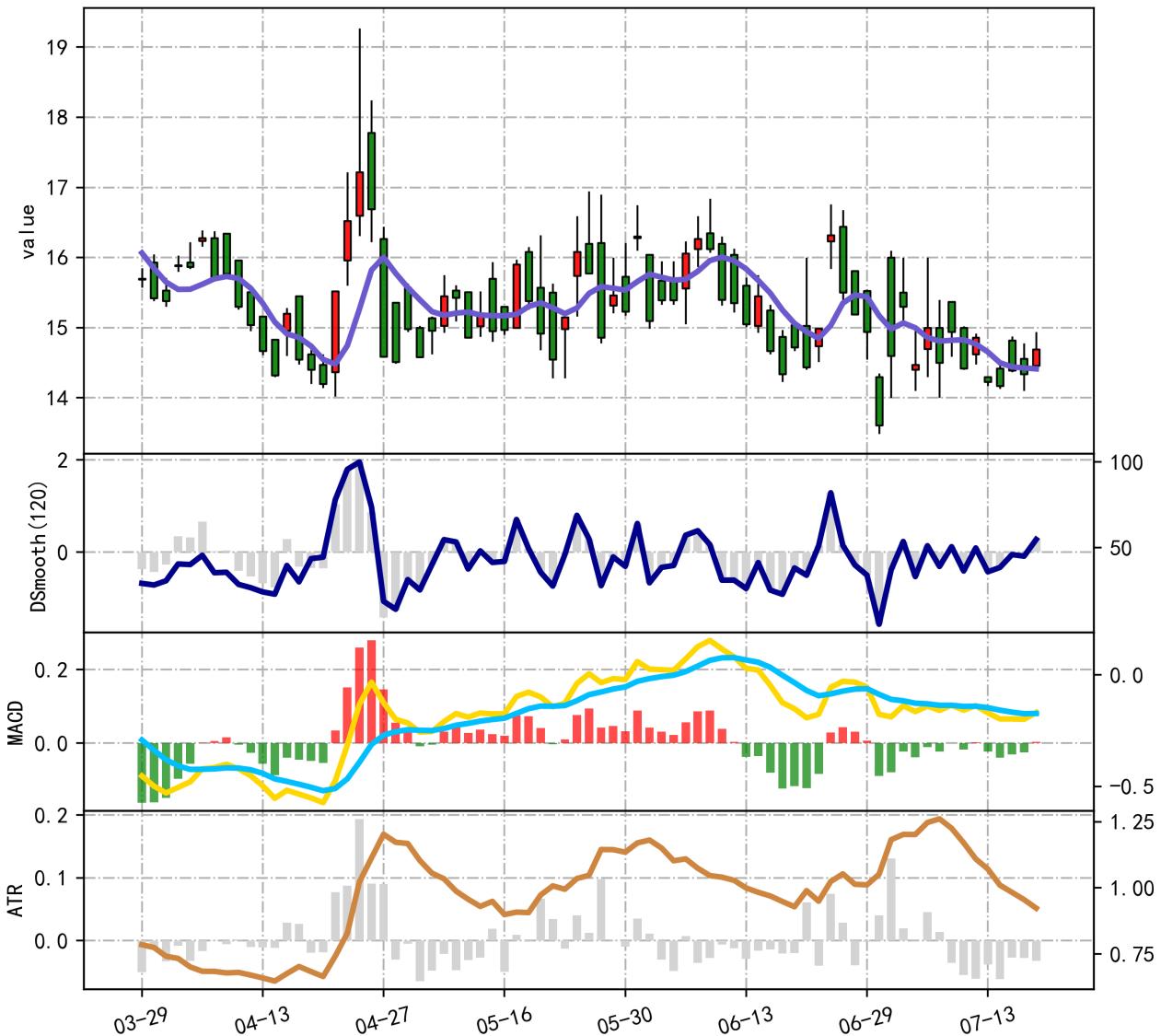
股指日报 (2023-07-20)

总括

恐慌指数 2023-07-19

- 选用沪深**300ETF**期权波动率指数作为整个市场恐慌指数的表征
- 其后另附上证**50ETF**、中证**500ETF**等的期权波动率指数
- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

1. 300ETF: 14.69 (64.5,52.3,54.8)
2. 50ETF: 15.06 (52.2,43.3,49.9)



检索量波动 2023-07-18

- 选用多个检索词刻画股市热度
 - 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出：检索词-检索量-分位数
 - 其后附有上证50、中证500、创业板等检索情况
1. 股市: 8540 (33.7, **19.5**)
 2. 股票: 42472 (**88.1, 89.4**)
 3. a股: 10617 (24.0, 30.6)
 4. 上证: 5278 (45.7, 50.8)
 5. 上证指数: 161173 (30.1, 34.0)



1. 牛市: 408 (**18.9, 18.9**)

2. 熊市: 265 (33.3, 30.4)



新高新低分位 2023-07-19

- 20-60-120日的新高新低数, 再对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出: 指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. all

- High: 825 (77.5,25.2); 294 (62.0,30.7); 105 (**17.0,16.7**);
- Low: 531 (**14.4,16.4**); 195 (**6.1,7.3**); 133 (**8.5,9.6**);



北向资金流入 2023-07-20

- 北向资金流入与其均线的偏离度
- 计算分位数所用的周期长度 (60,120,200)
- 输出: 累计流入量-偏离度-分位数

purchase: -0.18 (36.9, **10.8**,32.2)



主要指数分析 2023-07-18

包括内地宽基指数、港股指数等

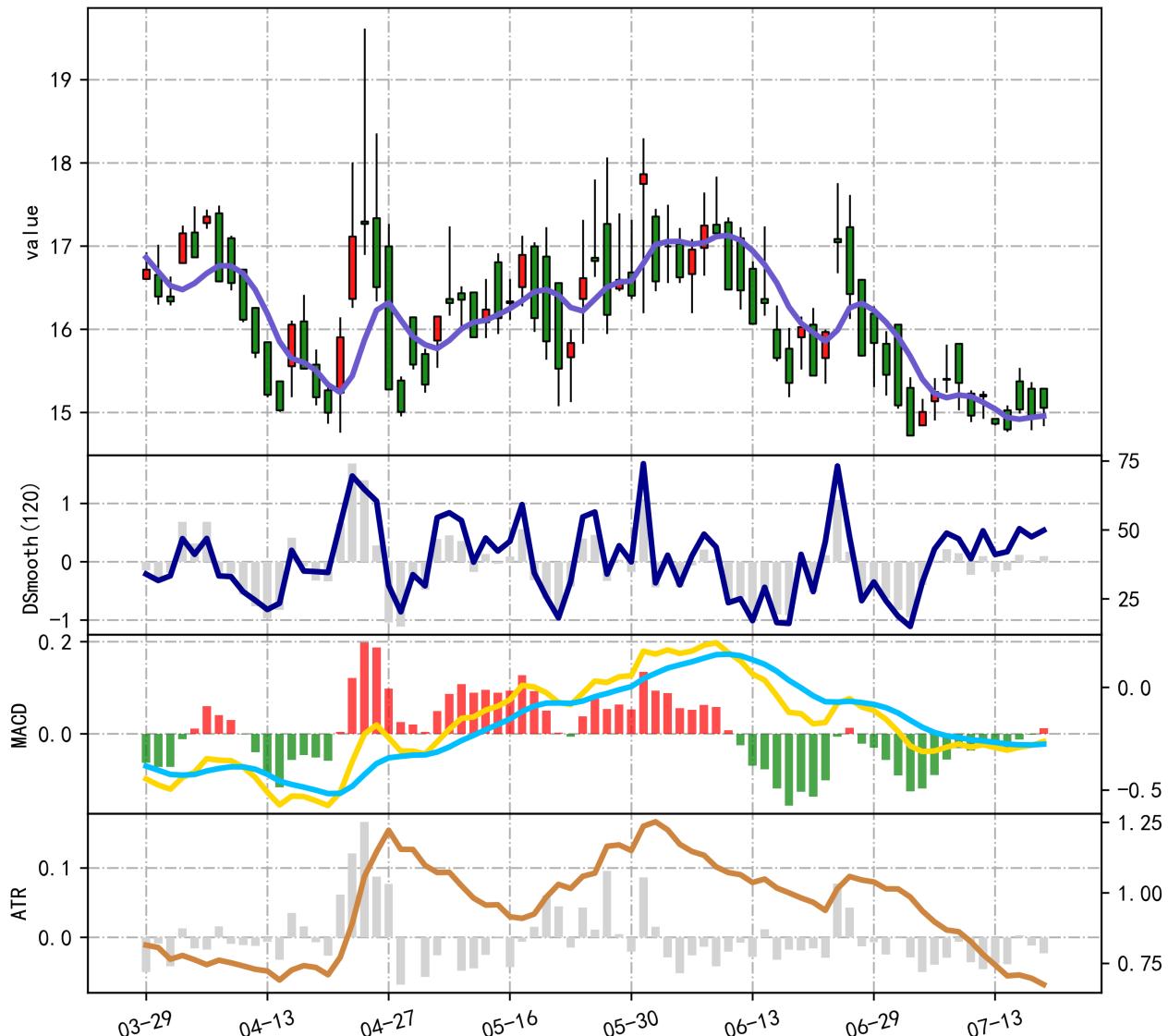
上证50

上证50期权波动率指数

- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

1. 300ETF: 14.69 (64.5,52.3,54.8)

2. 50ETF: 15.06 (52.2,43.3,49.9)



上证50搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出：检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8540 (33.7, **19.5**)
 2. 上证50: 1482 (27.2,27.7)



20-60-120日的新高新低数

- 对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出：指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. sz50

- High: 8 (53.3,29.6); 3 (25.0, **17.6**); 1 (**10.0,10.0**);
- Low: 4 (**14.3,14.3**); 2 (**10.0,10.0**); 1 (**5.6,5.6**);



沪深300

沪深300期权波动率指数

- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
 - 输出：指数-波动率指数-分位数
1. 300ETF: 14.69 (64.5,52.3,54.8)
 2. 50ETF: 15.06 (52.2,43.3,49.9)



沪深300搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
- 输出：检索词-检索量-分位数

- 股市: 8540 (33.7, 19.5)
- 沪深300: 3731 (30.5, 24.5)



沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出：指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. hs300

- High: 43 (59.7,29.4); 5 (**9.3,7.1**); 2 (**4.3,4.3**);
- Low: 32 (23.8,24.4); 15 (**14.2,14.2**); 10 (**13.2,13.2**);



中证500

中证500搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
- 输出：检索词-检索量-分位数

- 股市: 8540 (33.7, **19.5**)
- 中证500: 3220 (**18.6, 14.4**)



20-60-120日的新高新低数

- 再对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出：指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. zz500

- High: 101 (**100.0**,38.8); 21 (28.6,24.1); 9 (**15.5**,**15.5**);
- Low: 56 (**18.0**,21.3); 26 (**11.9**,**13.3**); 17 (**13.8**,**14.5**);



创业板指

创业板搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
- 输出：检索词-检索量-分位数

- 股市: 8540 (33.7, 19.5)
- 创业板指: 10422 (5.4, 8.9)

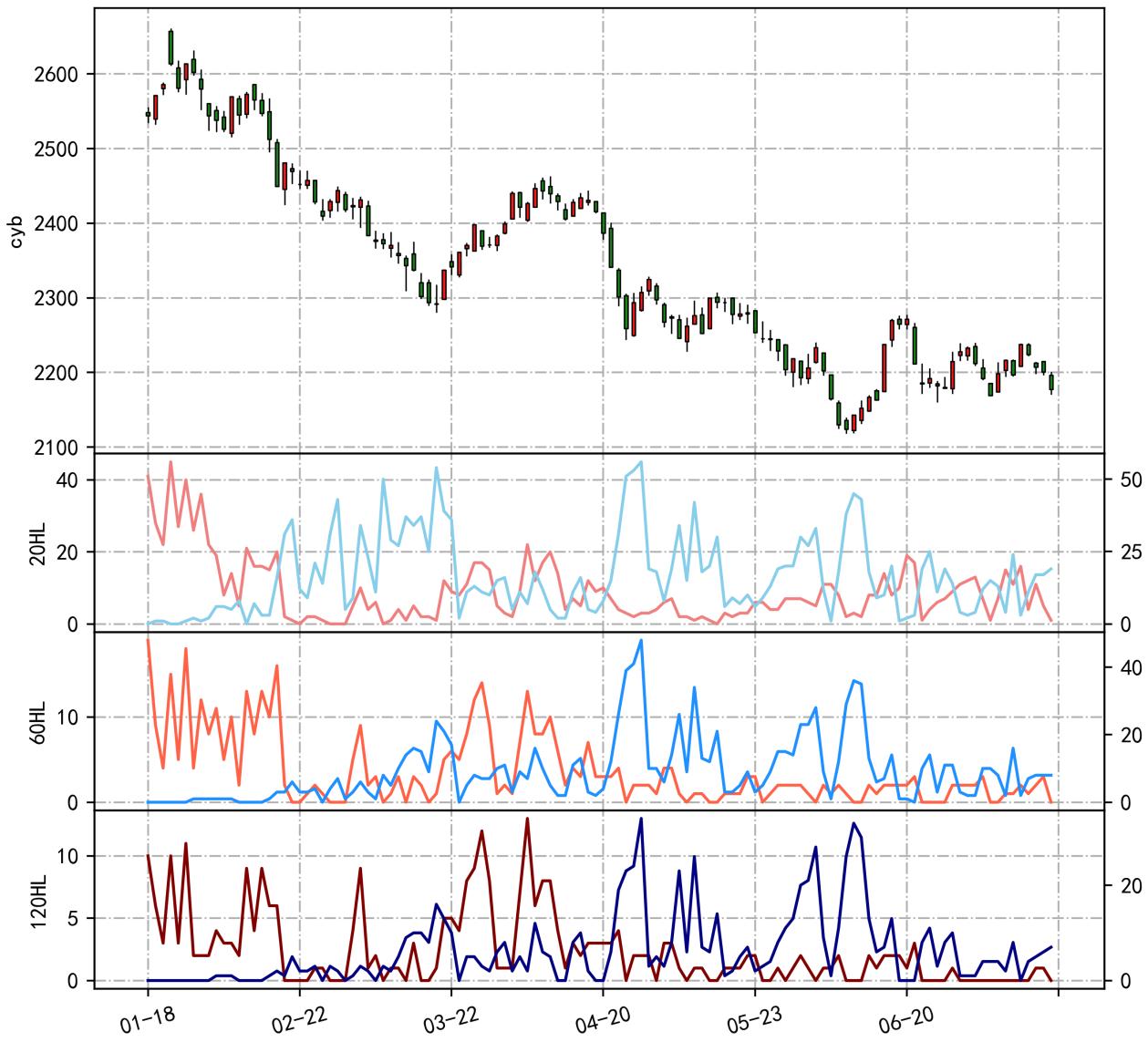


20-60-120日的新高新低数

- 再对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出：指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. cyb

- High: 1 (**5.3,2.2**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 19 (32.7,33.9); 8 (**16.7,16.7**); 7 (20.6,20.6);



科创50

科创板搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出：检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8540 (33.7, **19.5**)
 2. 科创50: 2682 (66.2,70.6)

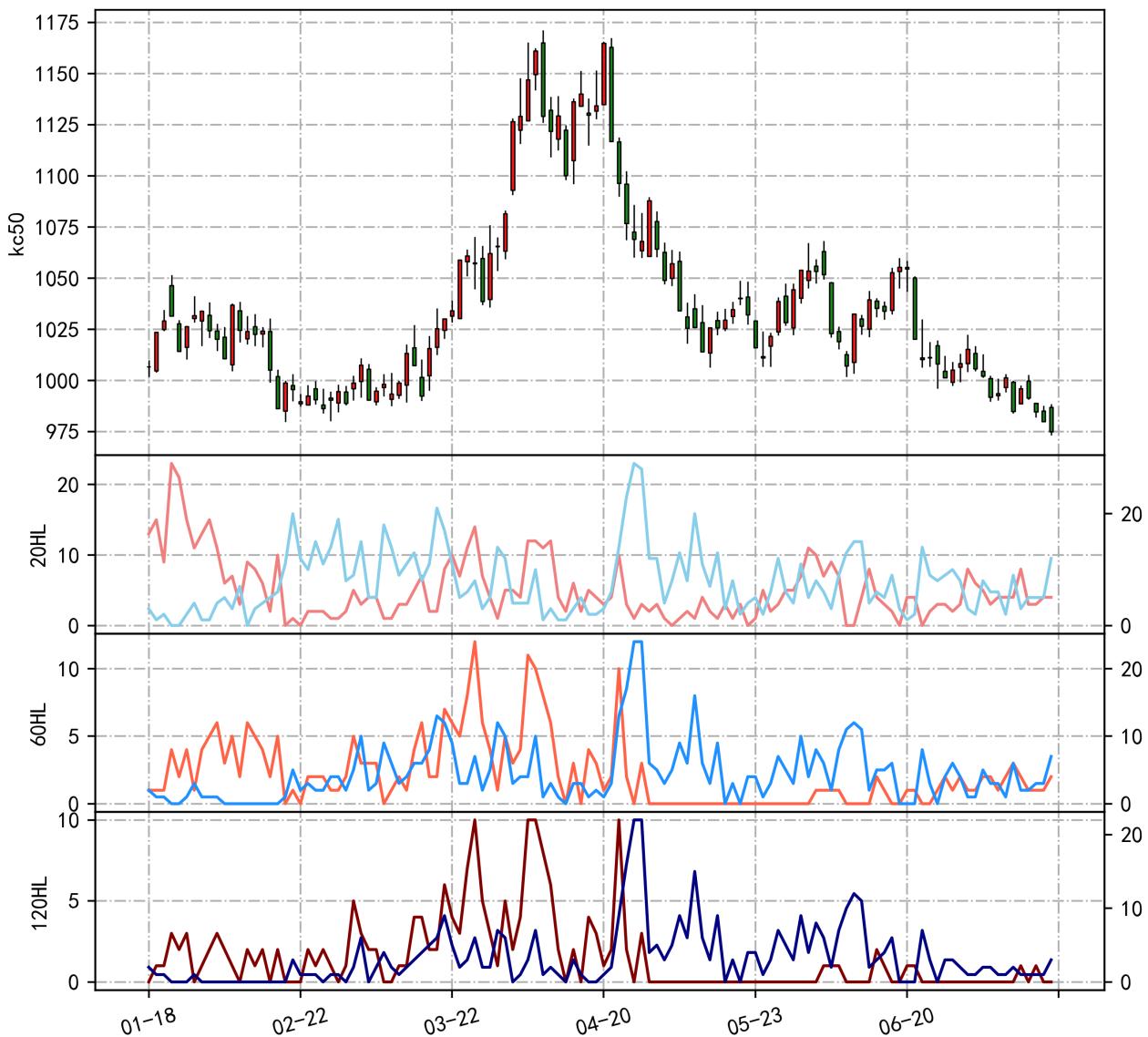


20-60-120日的新高新低数

- 对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
- 输出：指数-某一周期新高数(分位数)-某一周期新低数(分位数)

1. kc50

- High: 4 (36.4, **17.4**); 2 (**20.0, 16.7**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 12 (39.3, 41.4); 7 (29.2, 29.2); 3 (**13.6, 13.6**);



恒生

恒生、恒生科技搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
- 输出：检索词-检索量-分位数

1. 港股: 1896 (43.7,43.7)
2. 恒生指数: 15292 (75.6,60.4)



恒生科技指数: 8801 (44.6,45.9)



美股

美股搜索指数

- 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出: 检索词-检索量-分位数
1. 美股行情: 14141 (40.2, **11.0**)
 2. 道琼斯指数: 13202 (36.5, **9.5**)
 3. 纳斯达克指数: 9745 (63.2, 27.2)

