

股指日报 (2023-08-15)

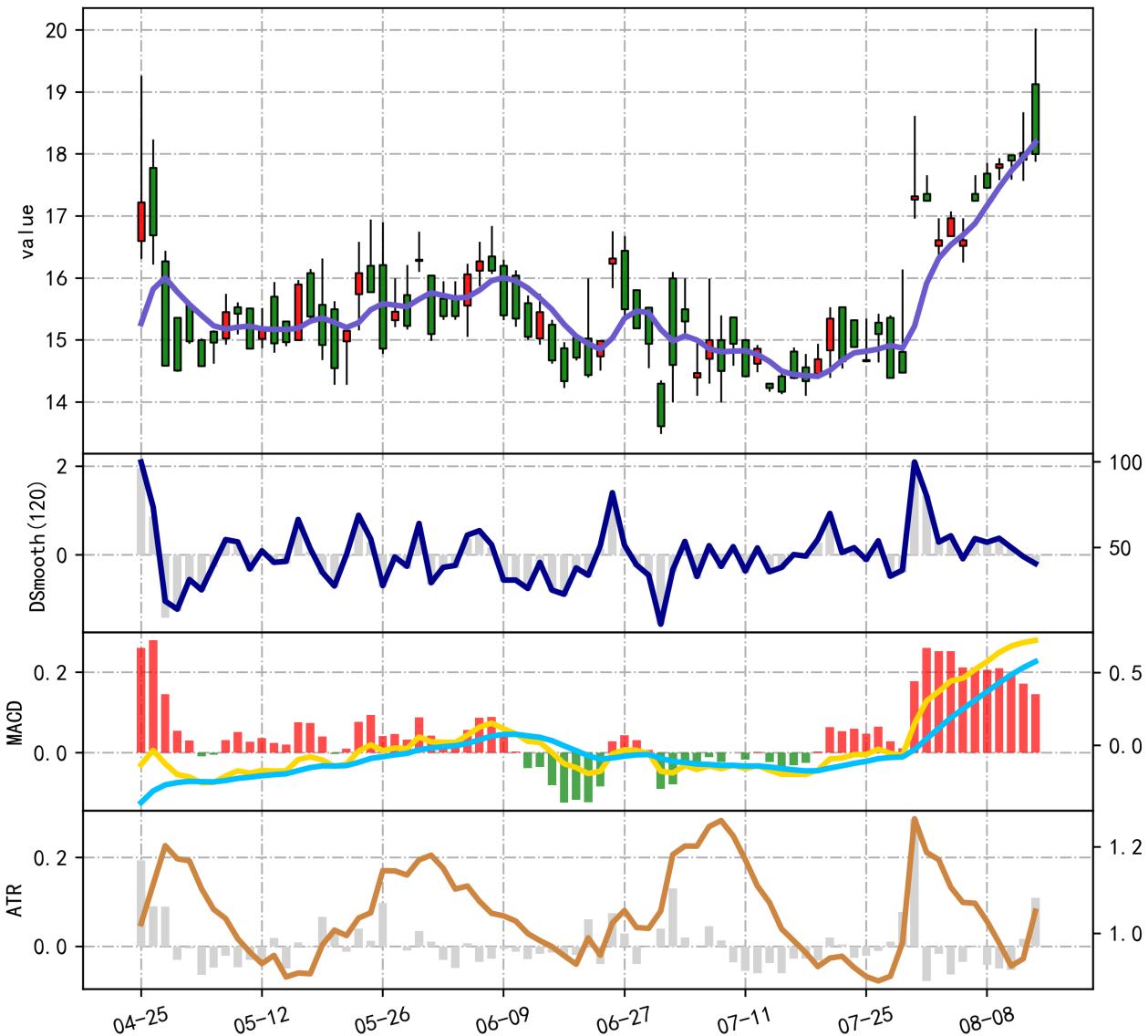
总括

恐慌指数 2023-08-14

- 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: 18.00 (**12.6,37.5,40.7**)

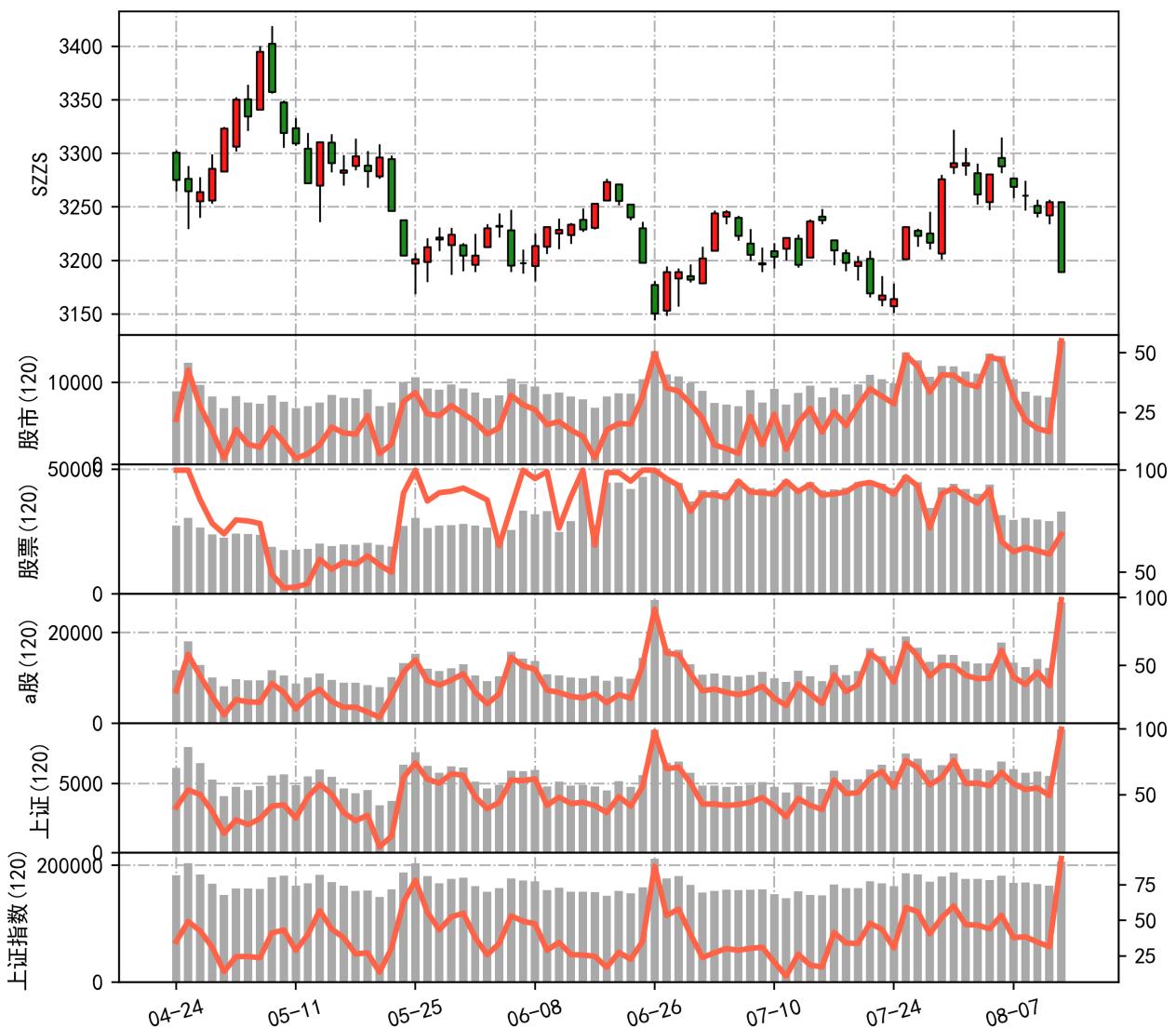
2. 50ETF: 18.73 (**0.0,8.4,12.5**)



检索量波动 2023-08-13

- 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
- 股市: 15040 (**100.0,55.0**)
 - 股票: 33080 (58.2,68.6)
 - a股: 26654 (**98.4,98.5**)
 - 上证: 8909 (**100.0,100.0**)

5. 上证指数: 205991 (93.7,93.5)



1. 牛市: 516 (34.7,34.7)

2. 熊市: 323 (73.5,73.5)



新高新低分位 2023-08-14

- 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: 175 (**3.8,3.8**); 80 (**2.6,2.6**); 24 (**2.4,1.4**);
- Low: 949 (43.0,28.6); 382 (33.6,**14.1**); 237 (27.3,**17.3**);



北向资金流入 2023-08-15

- 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: -0.39 (**13.1, 13.1, 29.0**)



主要指数分析 2023-08-13

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: 18.00 (**12.6,37.5,40.7**)

2. 50ETF: 18.73 (**0.0,8.4,12.5**)



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
- 股市: 15040 (**100.0**,55.0)
 - 上证50: 1563 (35.0,36.3)



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

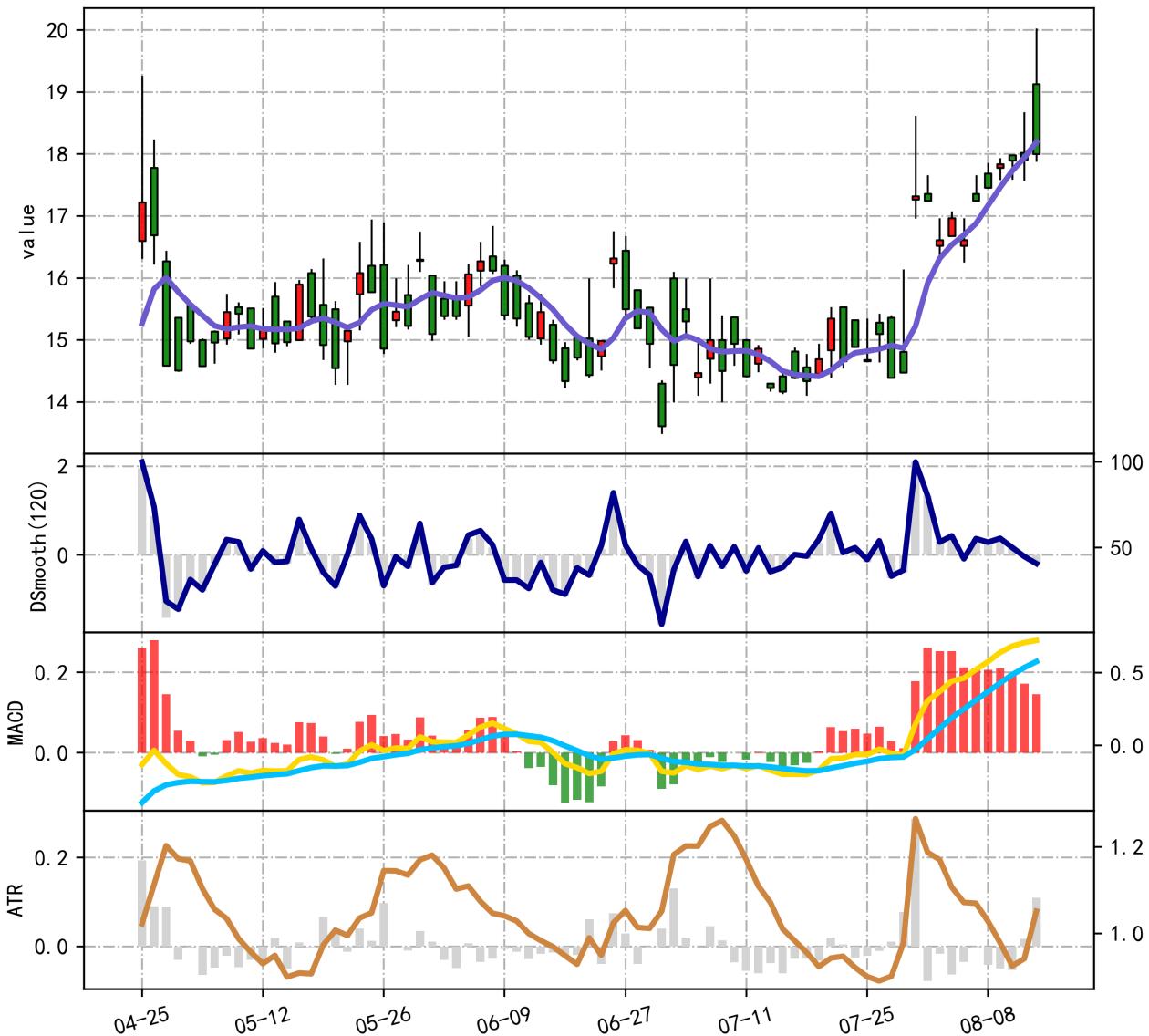
- High: 1 (**4.8,4.8**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 10 (35.7,35.7); 2 (**10.0,10.0**); 2 (**11.1,11.1**);



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: 18.00 (**12.6,37.5,40.7**)
 2. 50ETF: 18.73 (**0.0,8.4,12.5**)



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
1. 股市: 15040 (**100.0**,55.0)
 2. 沪深300: 4171 (42.0,42.0)



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: 4 (**2.2,2.2**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 59 (49.6,44.2); 20 (23.0,**18.9**); 17 (22.4,22.4);



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

1. 股市: 15040 (**100.0**,55.0)

2. 中证500: 3713 (54.9,38.7)



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: 8 (**1.9,1.9**); 3 (**2.7,2.7**); 1 (**3.0,1.7**);
- Low: 108 (49.7,39.3); 50 (36.2,24.7); 40 (39.8,33.6);



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: 15040 (**100.0**,55.0)
- 创业板指: 10961 (20.1,20.1)

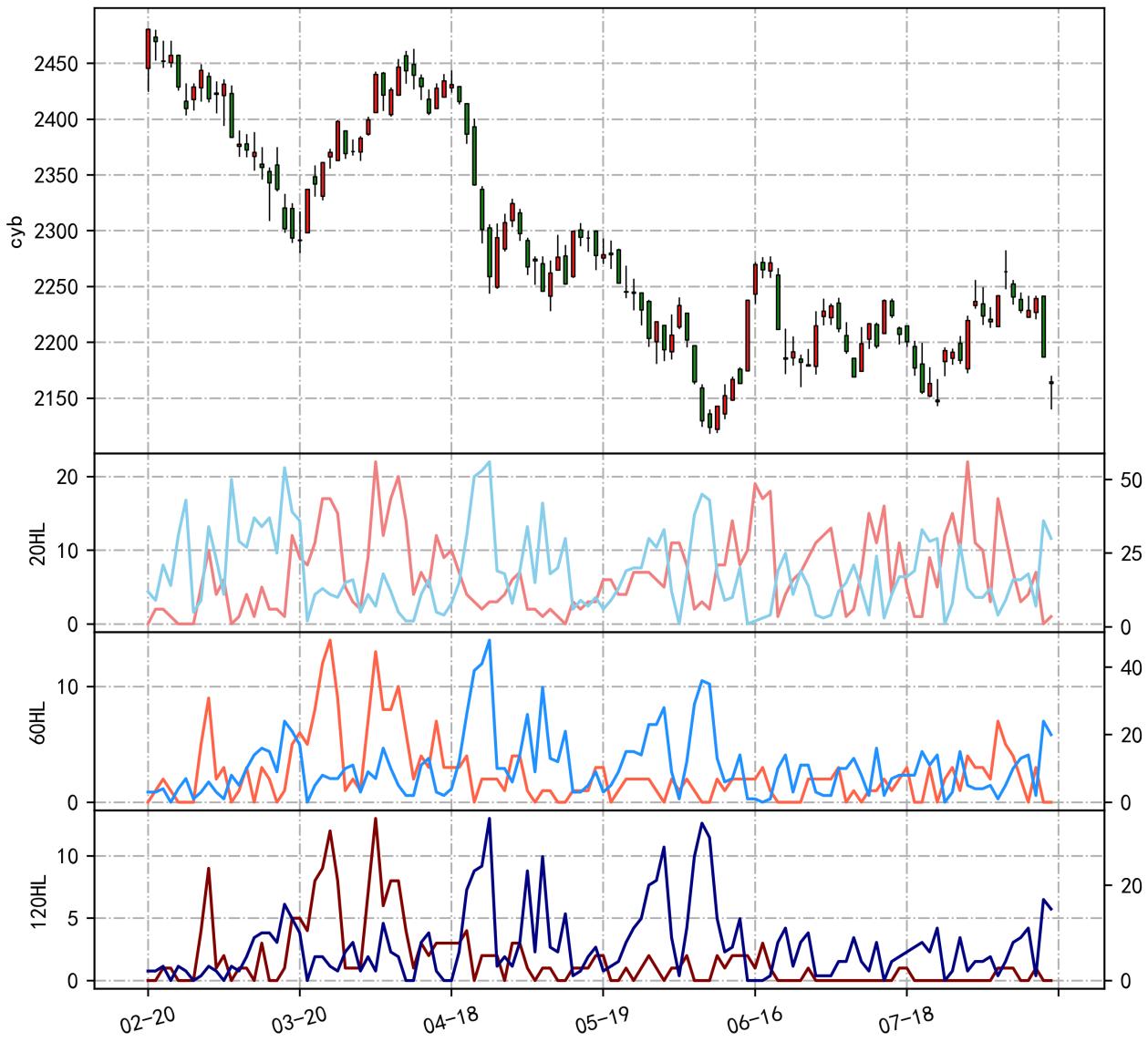


20-60-120日的新高新低数

- 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 (**4.5,4.5**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 30 (65.9,52.7); 20 (55.6,41.7); 15 (45.5,44.1);



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: 15040 (**100.0**,55.0)
 2. 科创50: 2694 (63.9,57.1)

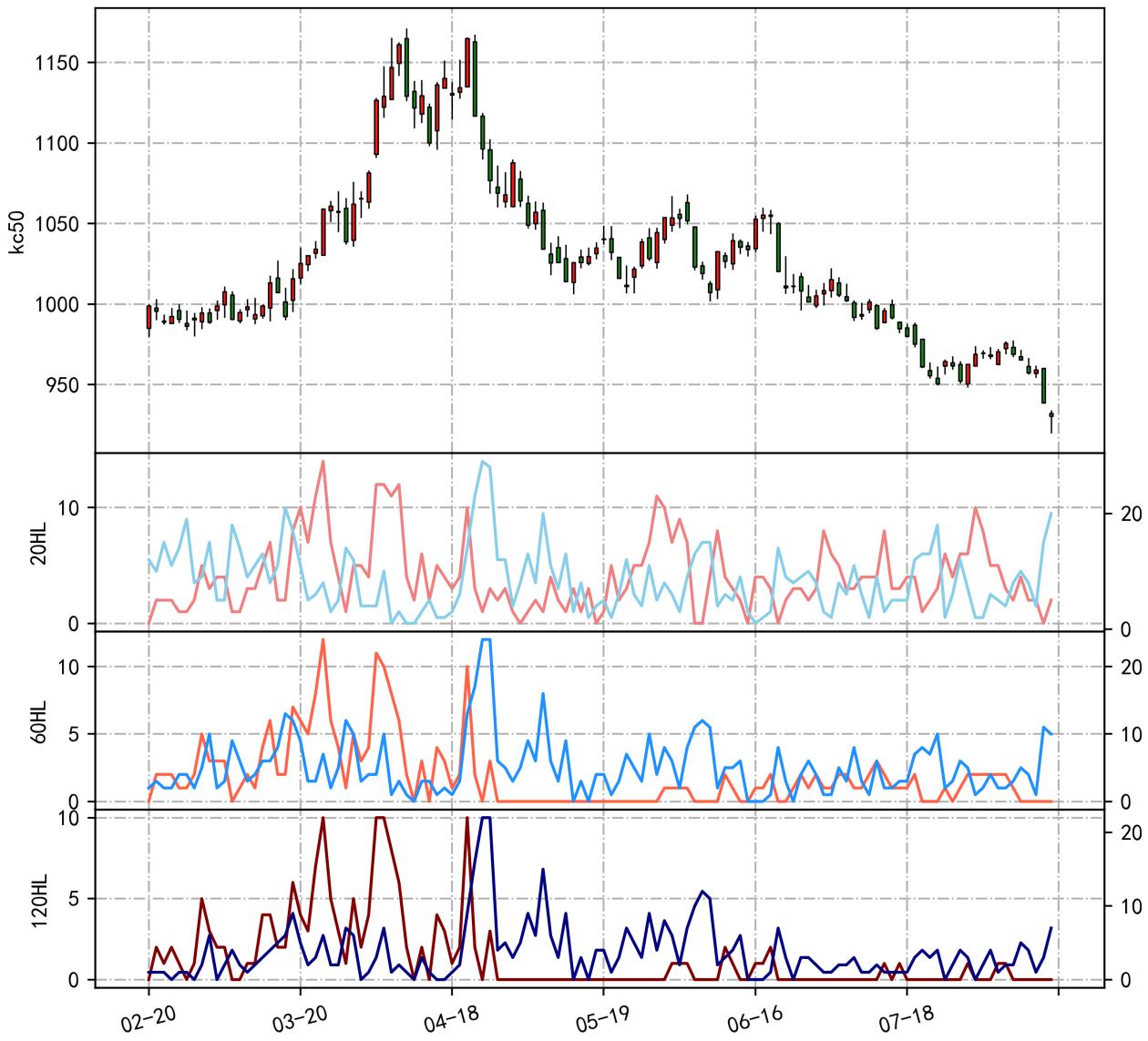


20-60-120日的新高新低数

- 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: 2 (**18.2, 14.3**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 20 (**100.0, 67.9**); 10 (**83.3, 41.7**); 7 (58.3, 31.8);



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: 1622 (30.3,30.3)
 2. 恒生指数: 15540 (77.9,62.1)



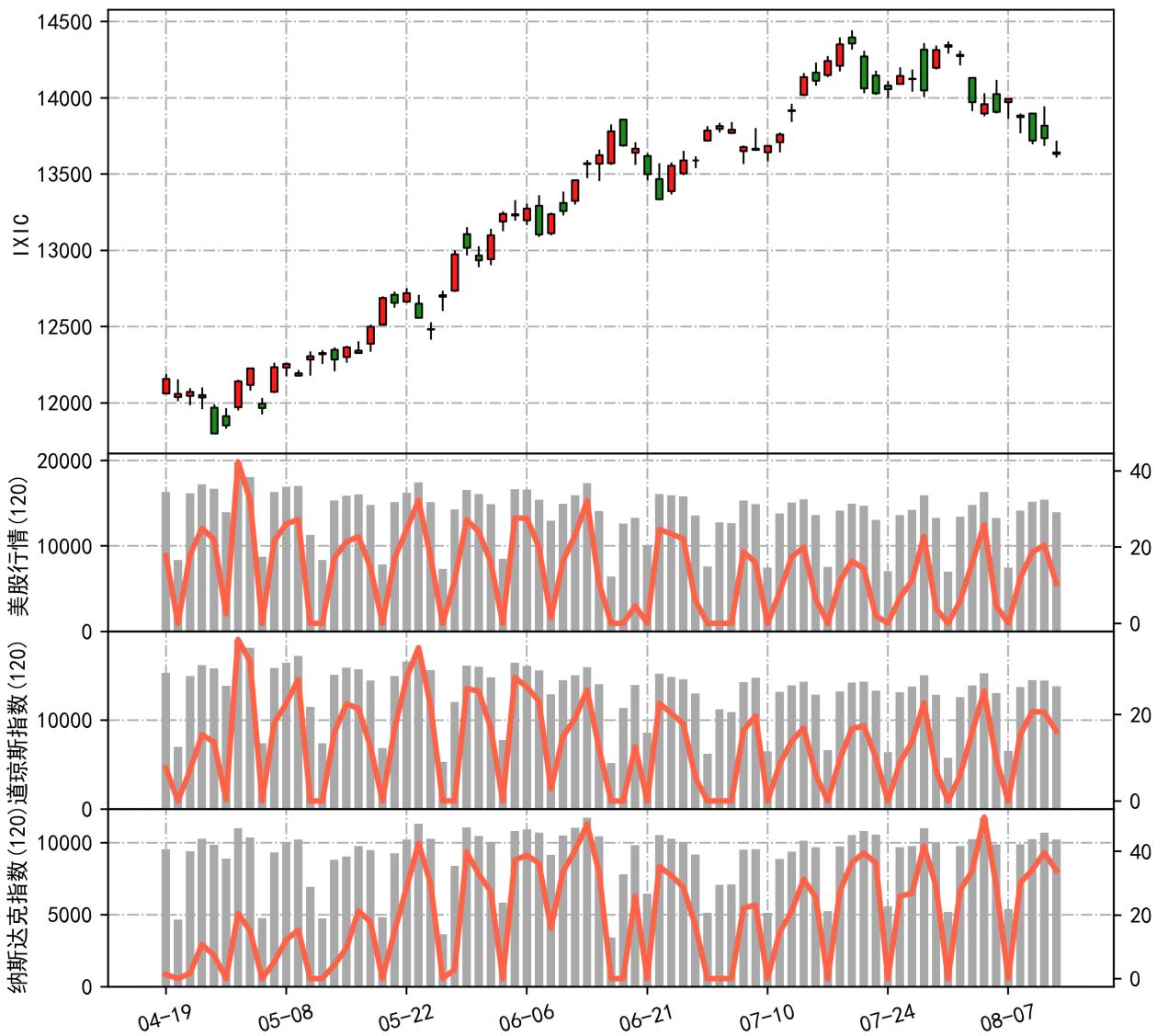
恒生科技指数: 10810 (45.8,52.9)



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: 13960 (53.4, **10.5**)
 2. 道琼斯指数: 13830 (54.7, **16.1**)
 3. 纳斯达克指数: 10198 (70.8, 34.0)



螺纹钢

螺纹钢搜索指数

- 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

螺纹钢: 771 (23.1, **19.3**)

