

# 股指日报 (2023-07-21)

## 总括

### 恐慌指数 2023-07-21

- 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: 14.66 (54.5,44.1,47.1)
2. 50ETF: 15.14 (47.6,39.9,46.9)



## 检索量波动 2023-07-21

- 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: 10390 (59.2,31.8)
- 股票: 44174 (**89.1,92.0**)
- a股: 14768 (50.5,52.0)
- 上证: 6360 (65.2,67.8)
- 上证指数: 169180 (42.7,43.7)



1. 牛市: 399 (**16.1, 16.1**)

2. 熊市: 268 (35.5, 31.2)



## 新高新低分位 2023-07-21

- 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: 573 (48.4, **15.7**); 182 (31.5, **15.6**); 50 (**0.3,0.3**);
- Low: 989 (30.0,31.6); 238 (**7.8,9.0**); 144 (**9.3,10.5**);



## 北向资金流入 2023-07-21

- 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: 0.13 (60.6, **16.8**, 36.8)



## 主要指数分析 2023-07-21

包括内地宽基指数、港股指数等

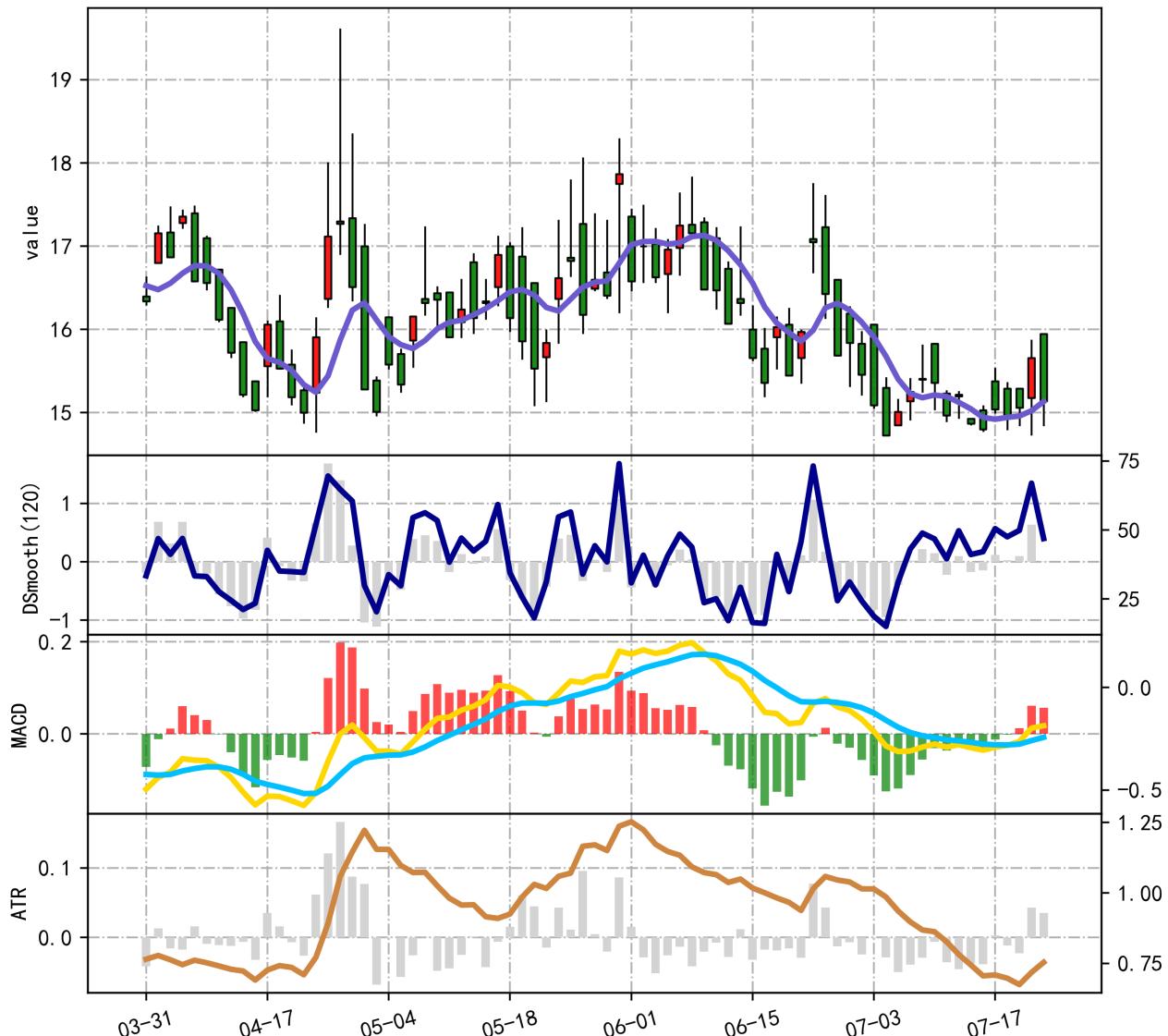
### 上证50

#### 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: 14.66 (54.5,44.1,47.1)

2. 50ETF: 15.14 (47.6,39.9,46.9)



## 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
- 股市: 10390 (59.2,31.8)
  - 上证50: 1480 (27.0,27.4)

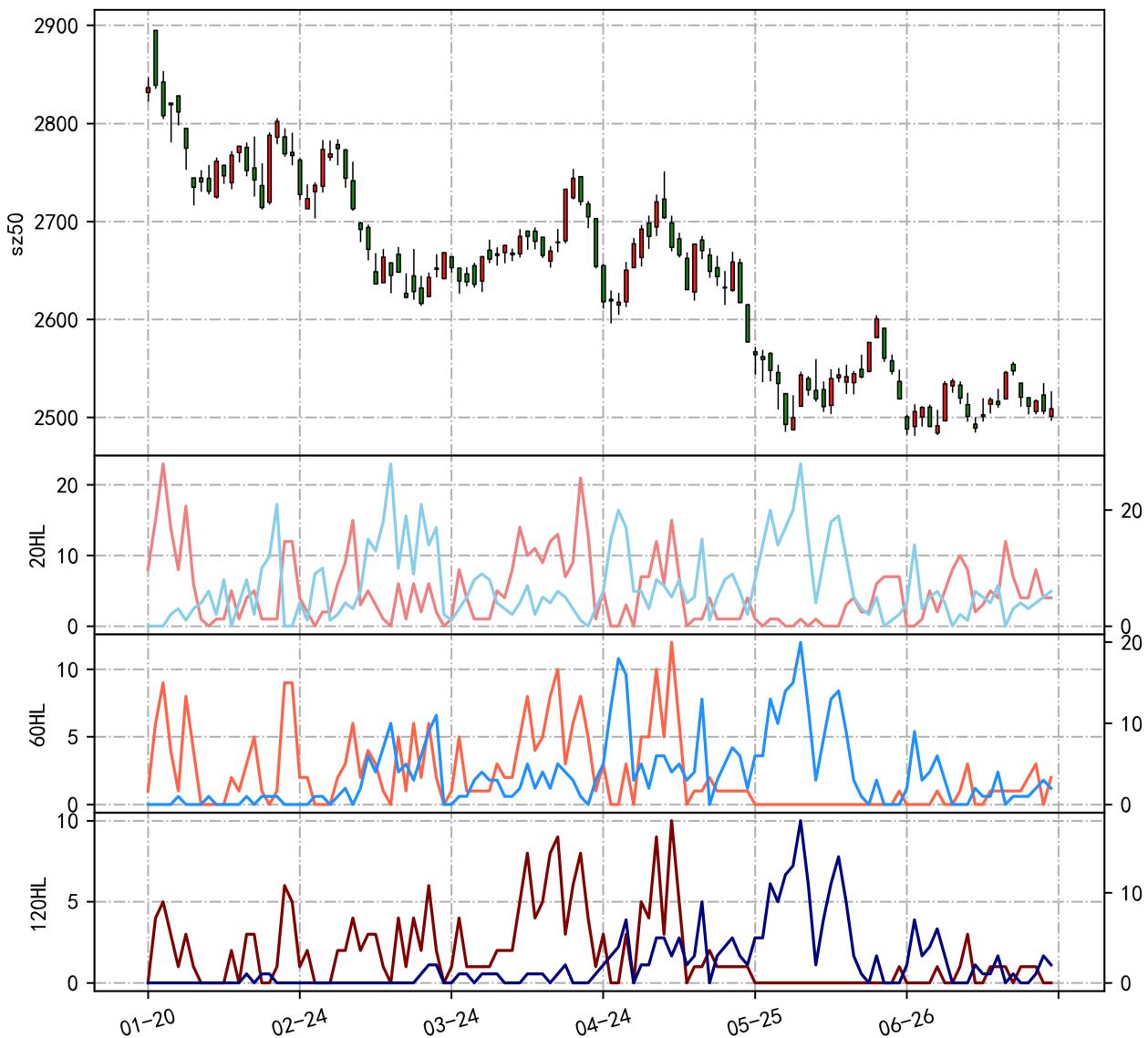


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 4 (26.7, **17.4**); 2 (**16.7, 16.7**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 6 (21.4, 21.4); 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: 14.66 (54.5,44.1,47.1)
  2. 50ETF: 15.14 (47.6,39.9,46.9)



## 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
1. 股市: 10390 (59.2,31.8)
  2. 沪深300: 3863 (40.3,32.4)



### 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: 27 (35.8, **18.9**); 5 (**9.3,9.1**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 45 (34.1,34.4); 19 (**17.9,17.9**); 13 (**17.1,17.1**);



## 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: 10390 (59.2,31.8)
- 中证500: 3199 (**17.3,13.3**)



## 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: 70 (67.0,26.0); 10 (**12.9,10.8**); 4 (**6.9,6.9**);
- Low: 72 (24.6,27.6); 23 (**10.4,11.7**); 14 (**11.2,12.0**);



## 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: 10390 (59.2,31.8)
- 创业板指: 11447 (27.4,30.1)



## 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: 9 (47.4, **20.0**); 3 (75.0, **16.7**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 29 (50.9,51.8); 11 (22.9,22.9); 6 (**17.6,17.6**);



## 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: 10390 (59.2,31.8)
  2. 科创50: 2985 (**91.3,81.6**)

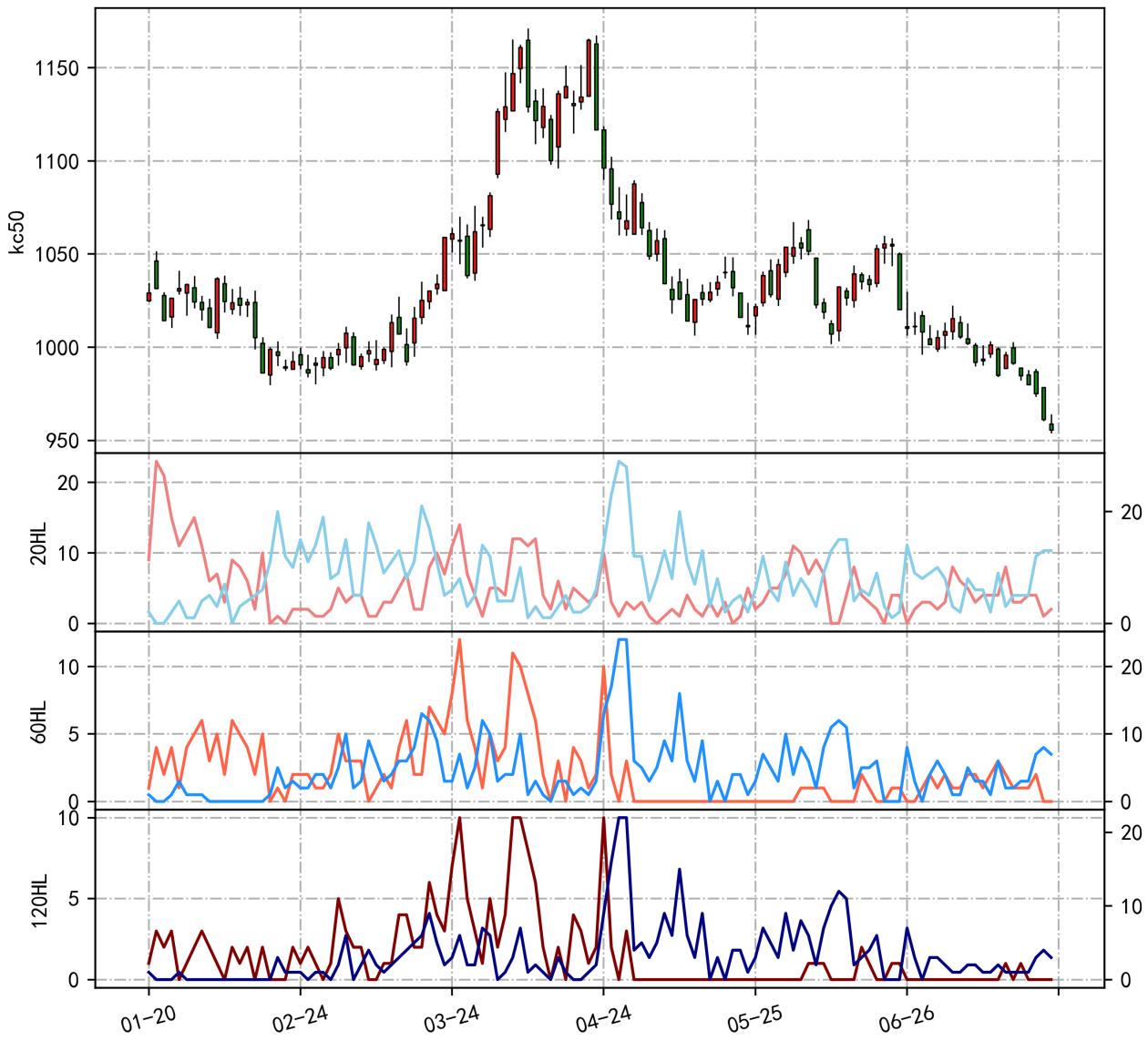


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 2 (**18.2, 8.7**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 13 (42.9, 44.8); 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: 1333 (**13.3,13.3**)
  2. 恒生指数: 14044 (63.4,51.7)



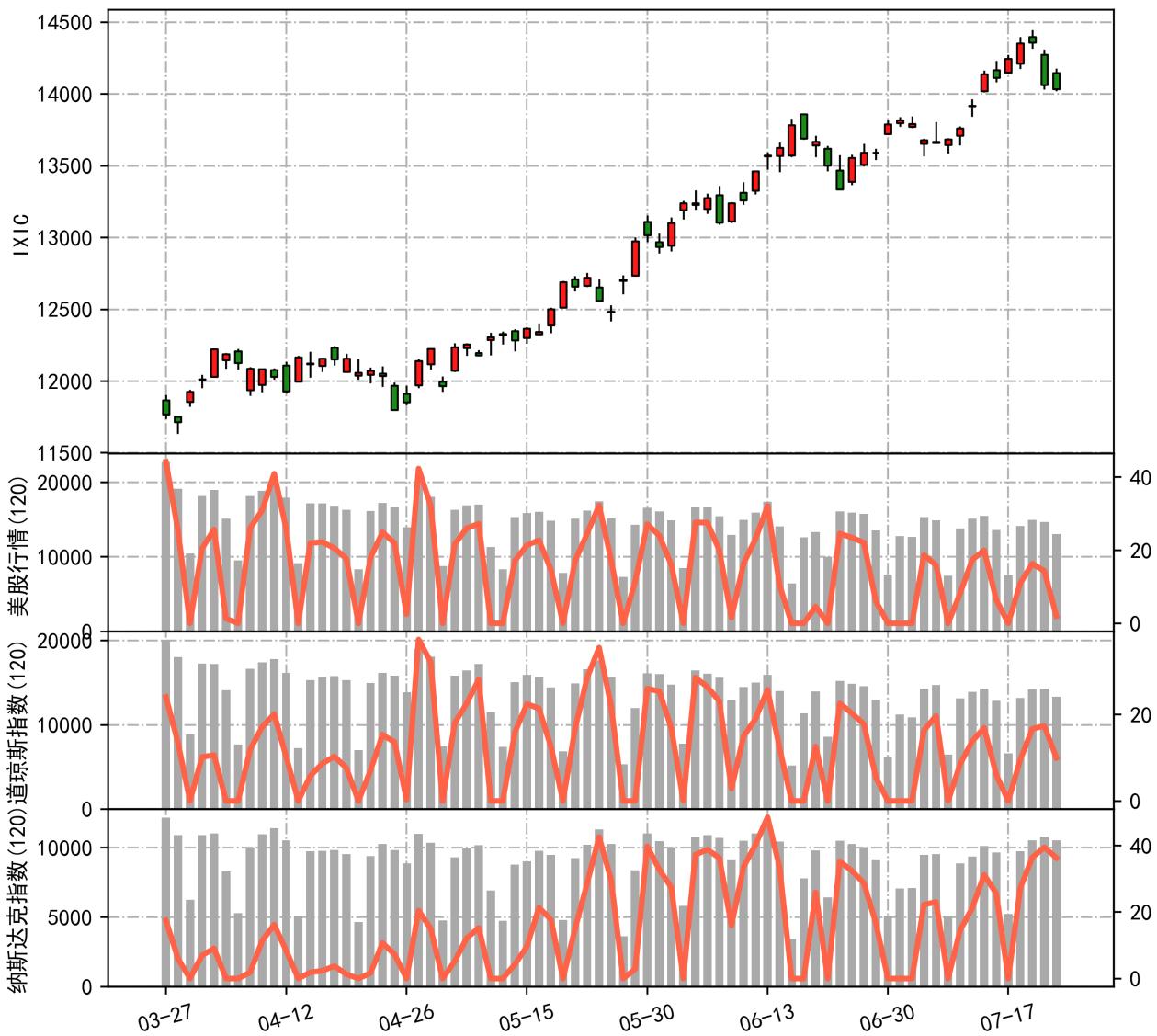
恒生科技指数: 9619 (55.3,56.9)



## 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: 13054 (27.3, **2.0**)
  2. 道琼斯指数: 13329 (38.8, **10.0**)
  3. 纳斯达克指数: 10536 (78.4, 36.4)



## 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: 893 (52.2,67.4)

