

# 股指日报 (2023-07-18)

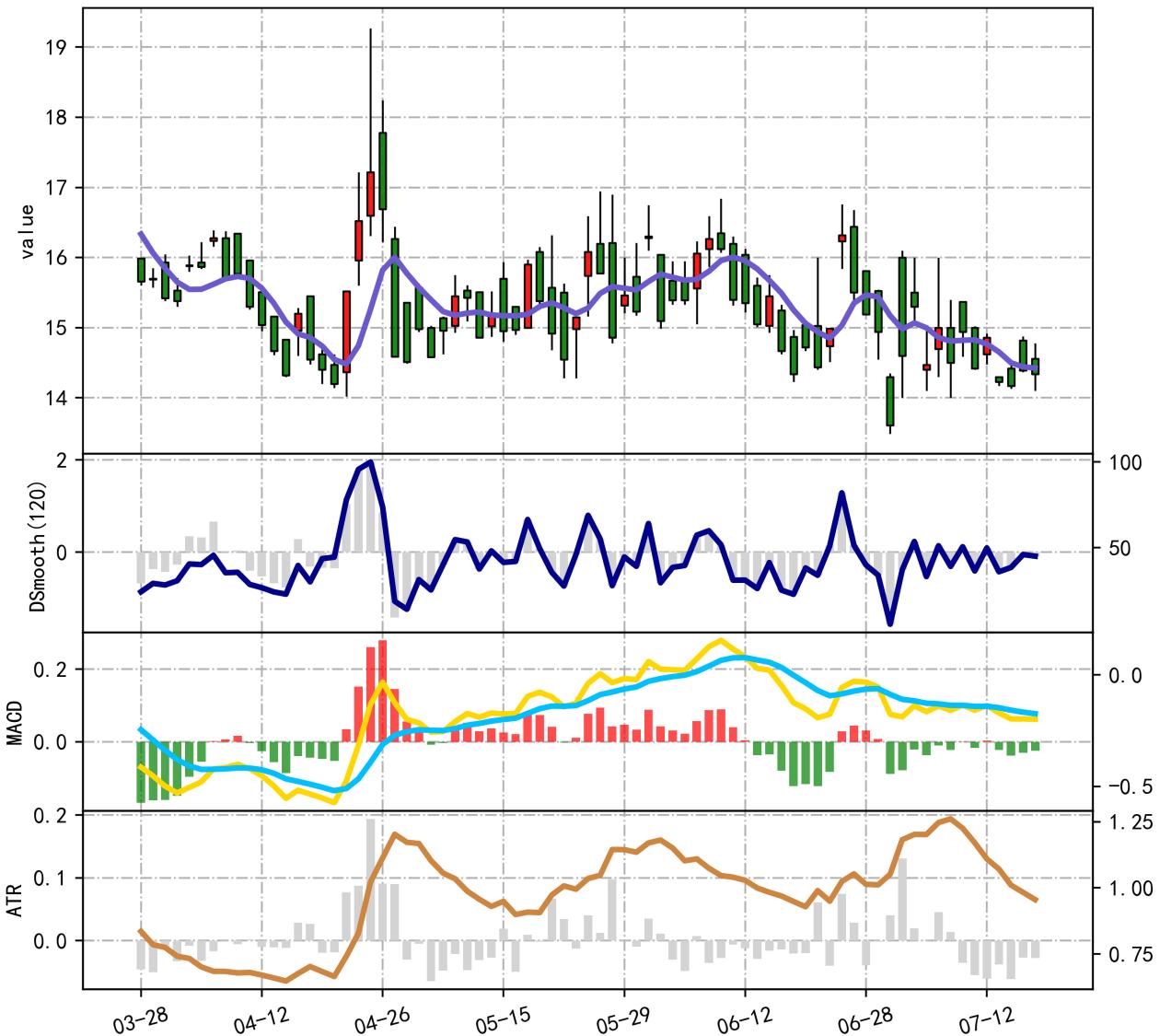
## 总括

### 恐慌指数 2023-07-18

- 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: 14.34 (51.8,42.0,45.0)

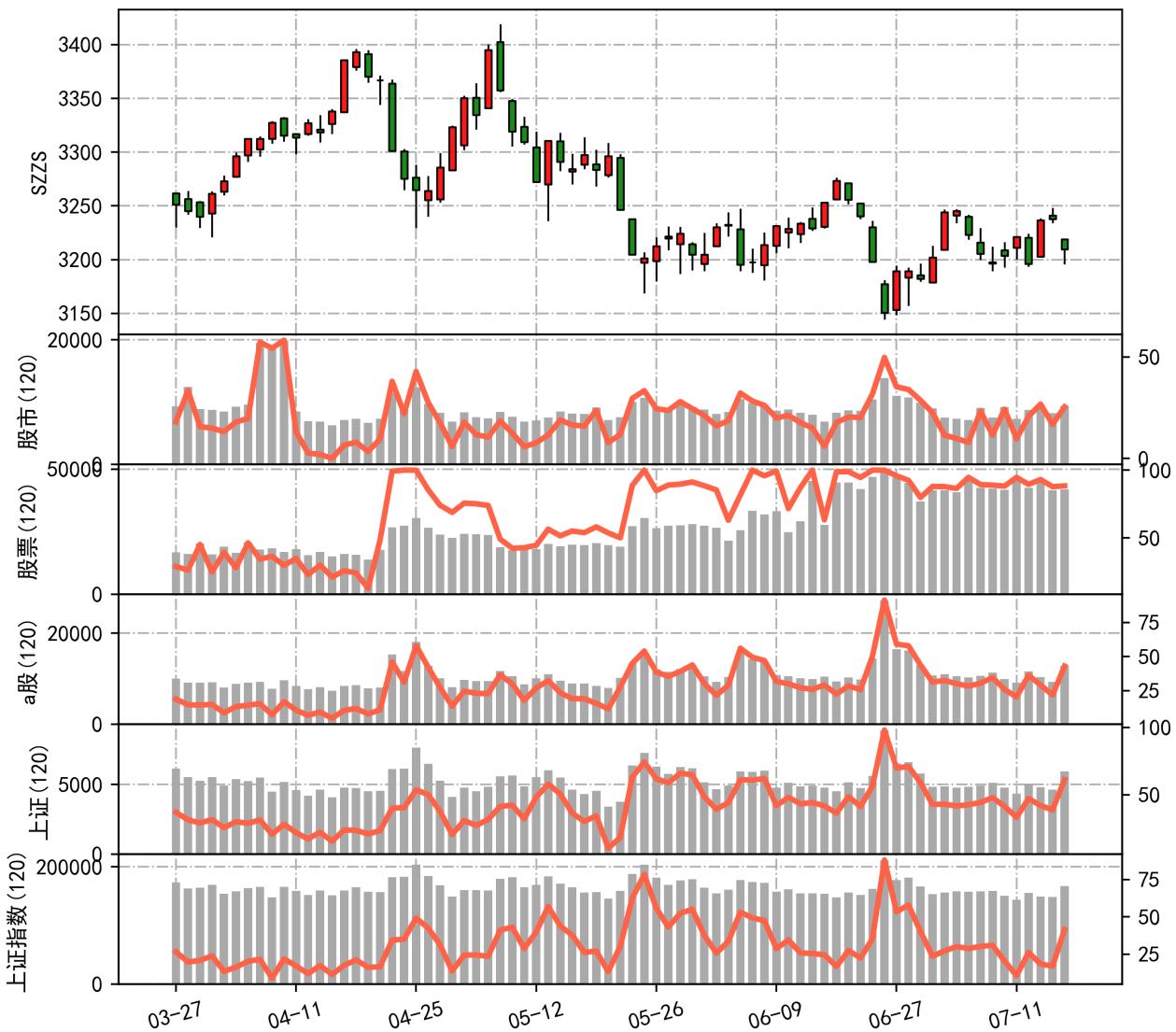
2. 50ETF: 14.97 (48.6,40.7,47.5)



## 检索量波动 2023-07-17

- 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: 9373 (46.5,25.4)
- 股票: 41853 (**87.0,88.4**)
- a股: 12861 (39.5,43.0)
- 上证: 5914 (57.6,61.2)
- 上证指数: 167324 (39.8,41.5)



1. 牛市: 402 (**17.0,17.0**)

2. 熊市: 254 (24.6,23.6)

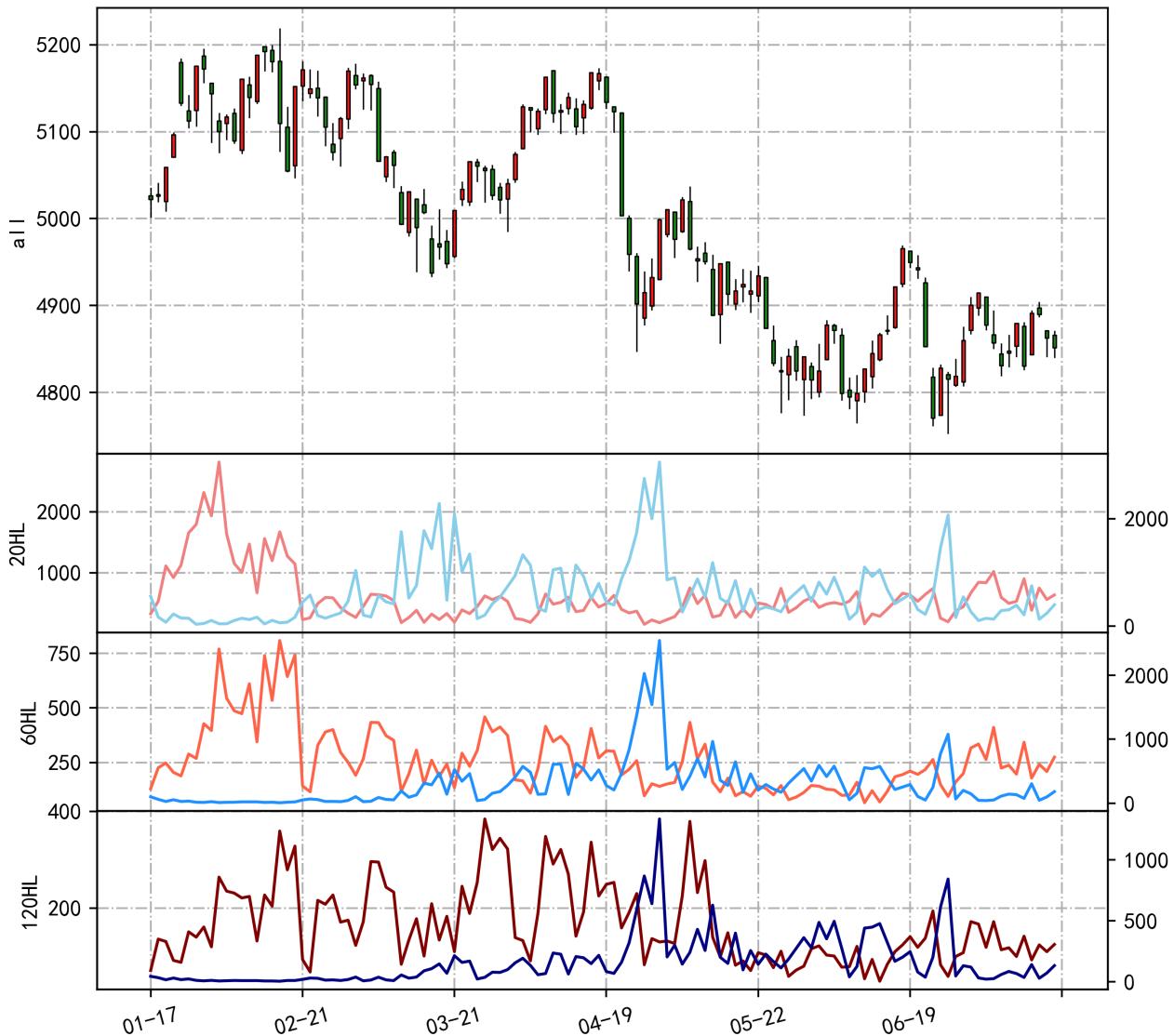


## 新高新低分位 2023-07-17

- 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: 636 (55.7, **18.1**); 275 (56.8, 28.1); 125 (23.0, 22.7);
- Low: 401 (**10.0, 12.1**); 183 (**5.6, 6.9**); 133 (**8.5, 9.6**);



## 北向资金流入 2023-07-18

- 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: 0.04 (51.4, **15.0**,35.4)



## 主要指数分析 2023-07-17

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: 14.34 (51.8,42.0,45.0)

2. 50ETF: 14.97 (48.6,40.7,47.5)



## 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: 9373 (46.5,25.4)
  - 上证50: 1646 (45.5,45.7)



## 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

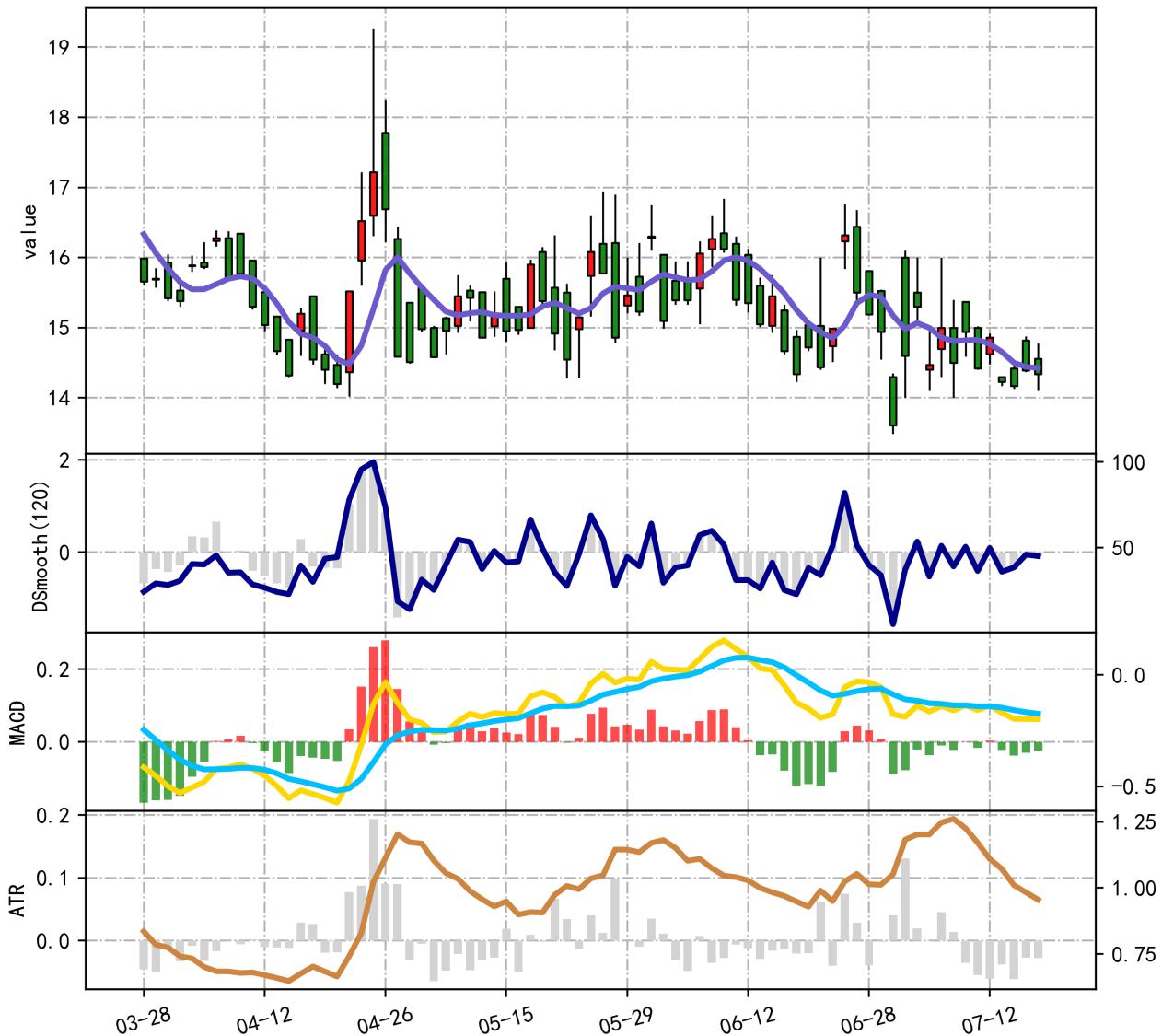
- High: 4 (**19.0, 14.8**); 1 (**8.3, 5.9**); 1 (**10.0, 10.0**);
- Low: 4 (**14.3, 14.3**); 1 (**5.0, 5.0**); 0 (**0.0, 0.0**);



## 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: 14.34 (51.8,42.0,45.0)
  2. 50ETF: 14.97 (48.6,40.7,47.5)



## 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
- 股市: 9373 (46.5,25.4)
  - 沪深300: 3830 (37.9,30.5)



### 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: 29 (26.8, **19.1**); 6 (**11.1, 8.6**); 2 (**4.3, 4.3**);
- Low: 16 (**11.1, 12.2**); 6 (**5.7, 5.7**); 3 (**3.9, 3.9**);



## 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: 9373 (46.5,25.4)
- 中证500: 3249 (20.6, **15.8**)



## 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: 52 (44.6, **18.6**); 14 (**18.6, 15.7**); 8 (**13.8, 13.8**);
- Low: 57 (**18.4, 21.7**); 34 (**16.1, 17.3**); 22 (**18.1, 18.8**);



## 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
1. 股市: 9373 (46.5,25.4)
  2. 创业板指: 10378 (**4.4,8.0**)

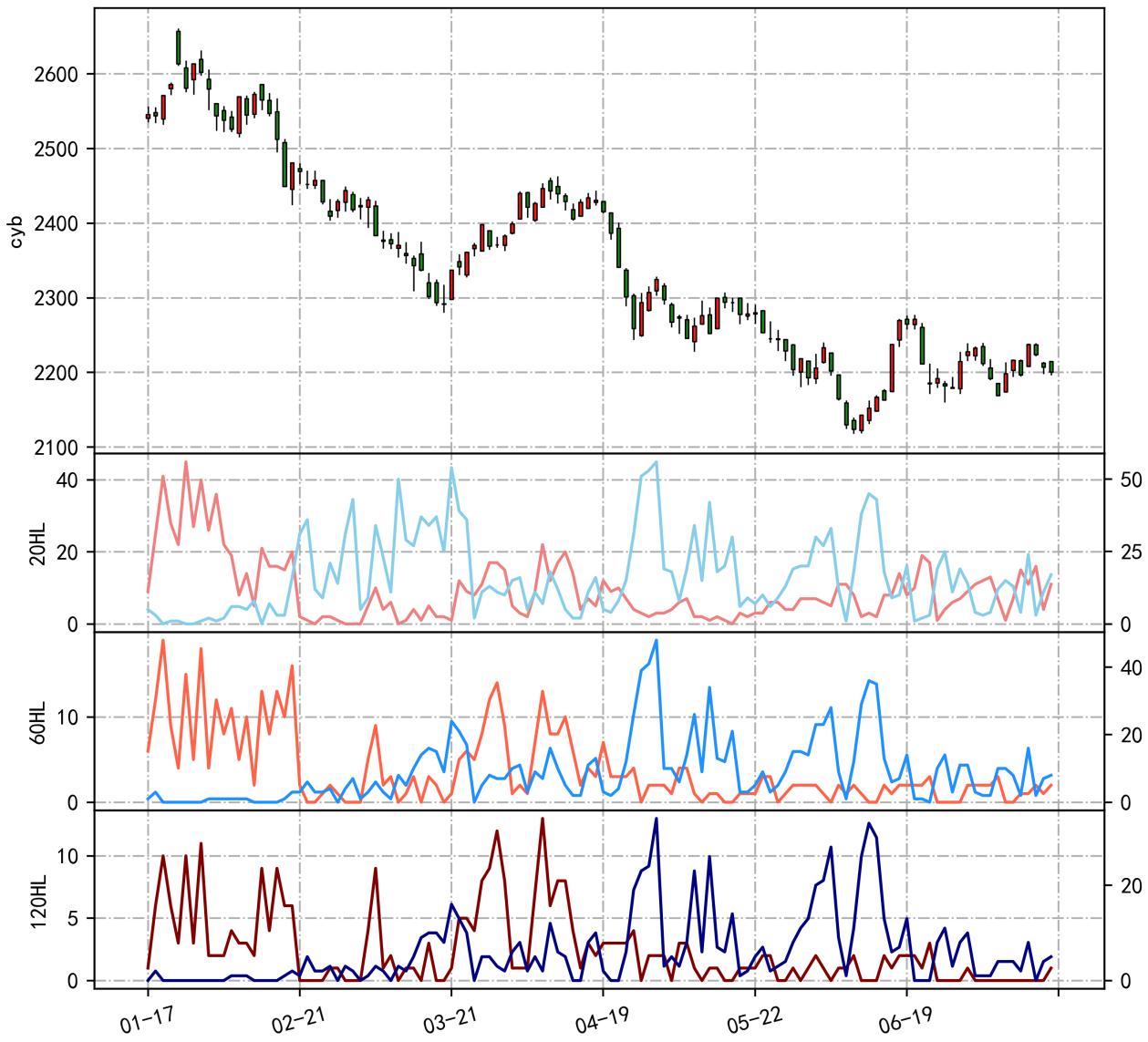


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 11 (57.9,24.4); 2 (28.6, **10.5**); 1 (25.0, **7.7**);
- Low: 17 (29.1,30.4); 8 (**16.7**, **16.7**); 5 (**14.7**, **14.7**);



## 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: 9373 (46.5,25.4)
  2. 科创50: 2440 (39.8,60.9)

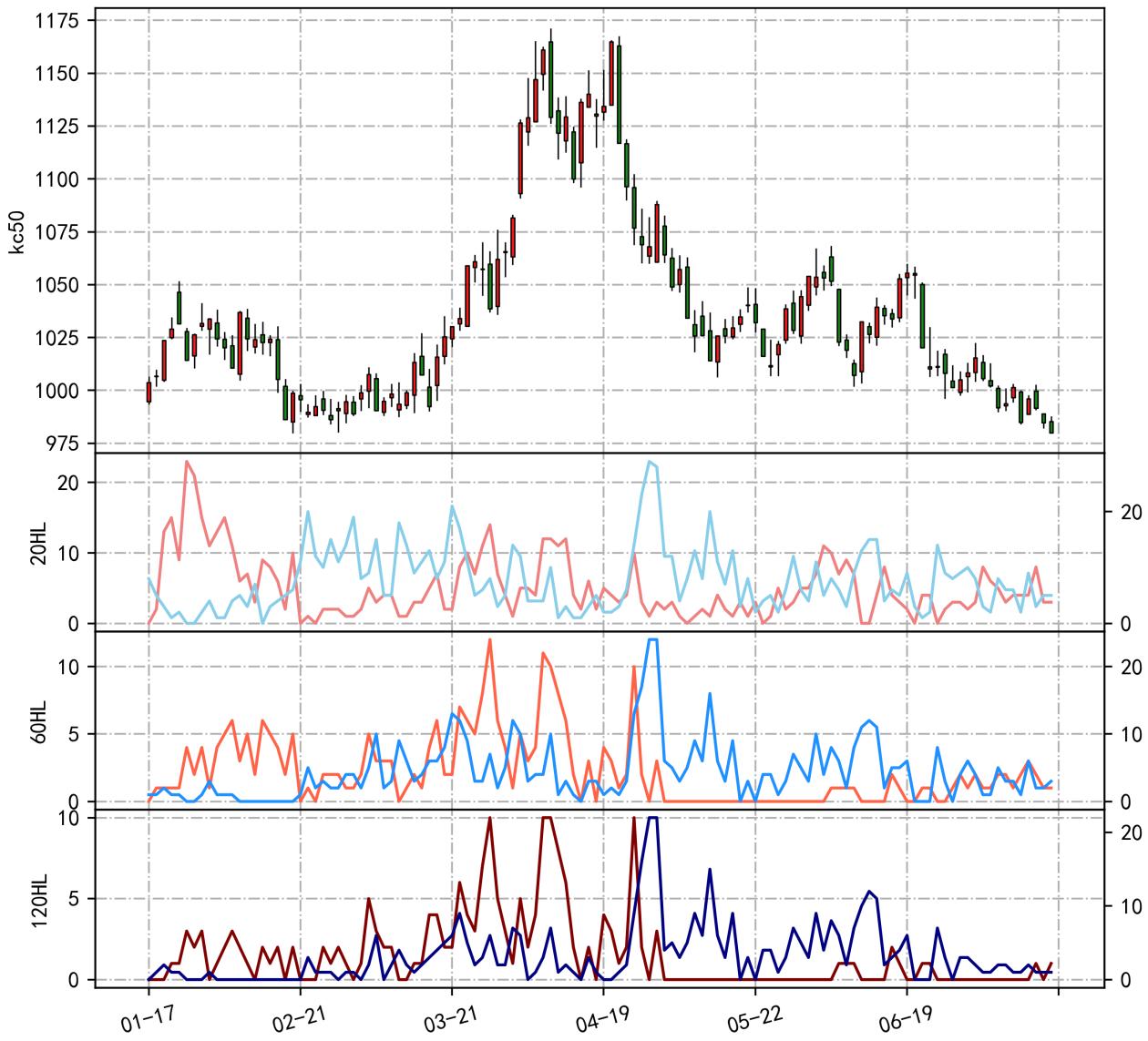


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 3 (27.3, **13.0**); 1 (**10.0,8.3**); 1 (**10.0,10.0**);
- Low: 5 (**14.3,17.2**); 3 (**12.5,12.5**); 1 (**4.5,4.5**);



## 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: 3642 (**100.0,100.0**)

2. 恒生指数: 9017 (**0.0,6.0**)



恒生科技指数: 3896 (**0.0,0.0**)



## 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

- 美股行情: 7536 (**0.0,0.0**)
- 道琼斯指数: 6614 (**0.0,0.0**)
- 纳斯达克指数: 5243 (**0.0,0.0**)

