

股指日报 (2023-08-04)

总括

恐慌指数 2023-08-04

- 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: 17.26 (35.2,53.6,56.0)
2. 50ETF: 18.55 (34.3,44.9,52.3)



检索量波动 2023-08-04

- 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
1. 股市: 13205 (**93.4**,46.9)
 2. 股票: 31628 (56.6,65.1)
 3. a股: 17767 (65.5,61.2)
 4. 上证: 6572 (68.6,67.1)
 5. 上证指数: 182231 (61.9,53.6)



1. 牛市: 805 (74.7,74.7)

2. 熊市: 284 (47.3,38.8)



新高新低分位 2023-08-04

- 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: 406 (21.2, **16.6**); 213 (23.7, **19.8**); 115 (36.7, **19.7**);
- Low: 468 (**18.5, 13.5**); 92 (**5.9, 3.3**); 51 (**4.9, 3.5**);



北向资金流入 2023-08-04

- 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: 1.34 (79.6,55.0,54.8)



主要指数分析 2023-08-04

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: 17.26 (35.2,53.6,56.0)

2. 50ETF: 18.55 (34.3,44.9,52.3)



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: 13205 (**93.4**,46.9)
 2. 上证50: 1997 (78.7,78.8)



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: 7 (33.3,33.3); 2 (22.2, **16.7**); 1 (25.0, **10.0**);
- Low: 1 (**3.6,3.6**); 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: 17.26 (35.2,53.6,56.0)
 2. 50ETF: 18.55 (34.3,44.9,52.3)



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: 13205 (**93.4**,46.9)
 2. 沪深300: 4995 (76.7,76.7)

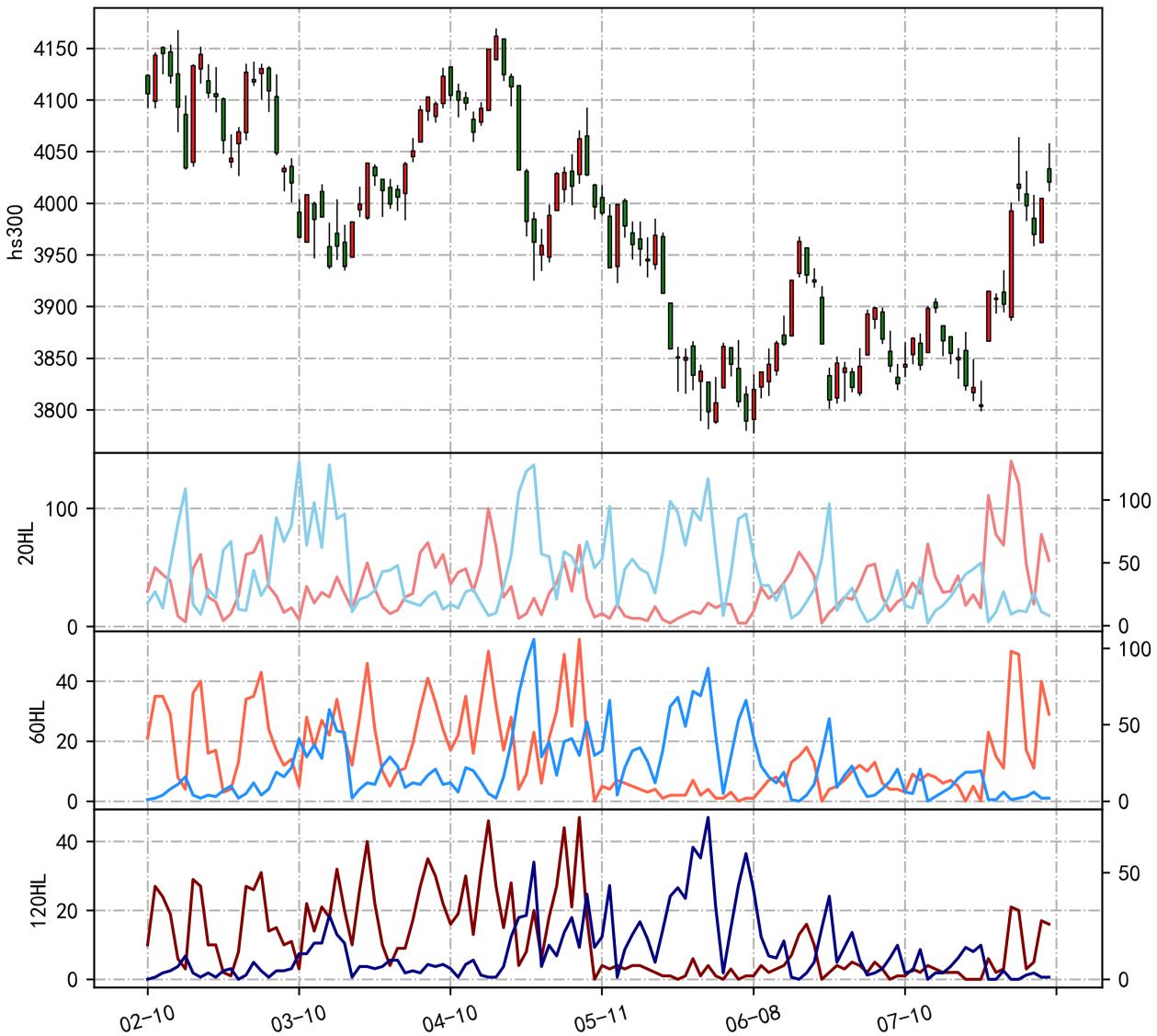


沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 56 (38.7,38.7); 29 (58.0,53.7); 16 (76.2,34.0);
- Low: 8 (**5.2,4.7**); 2 (**2.3,1.9**); 1 (**1.3,1.3**);

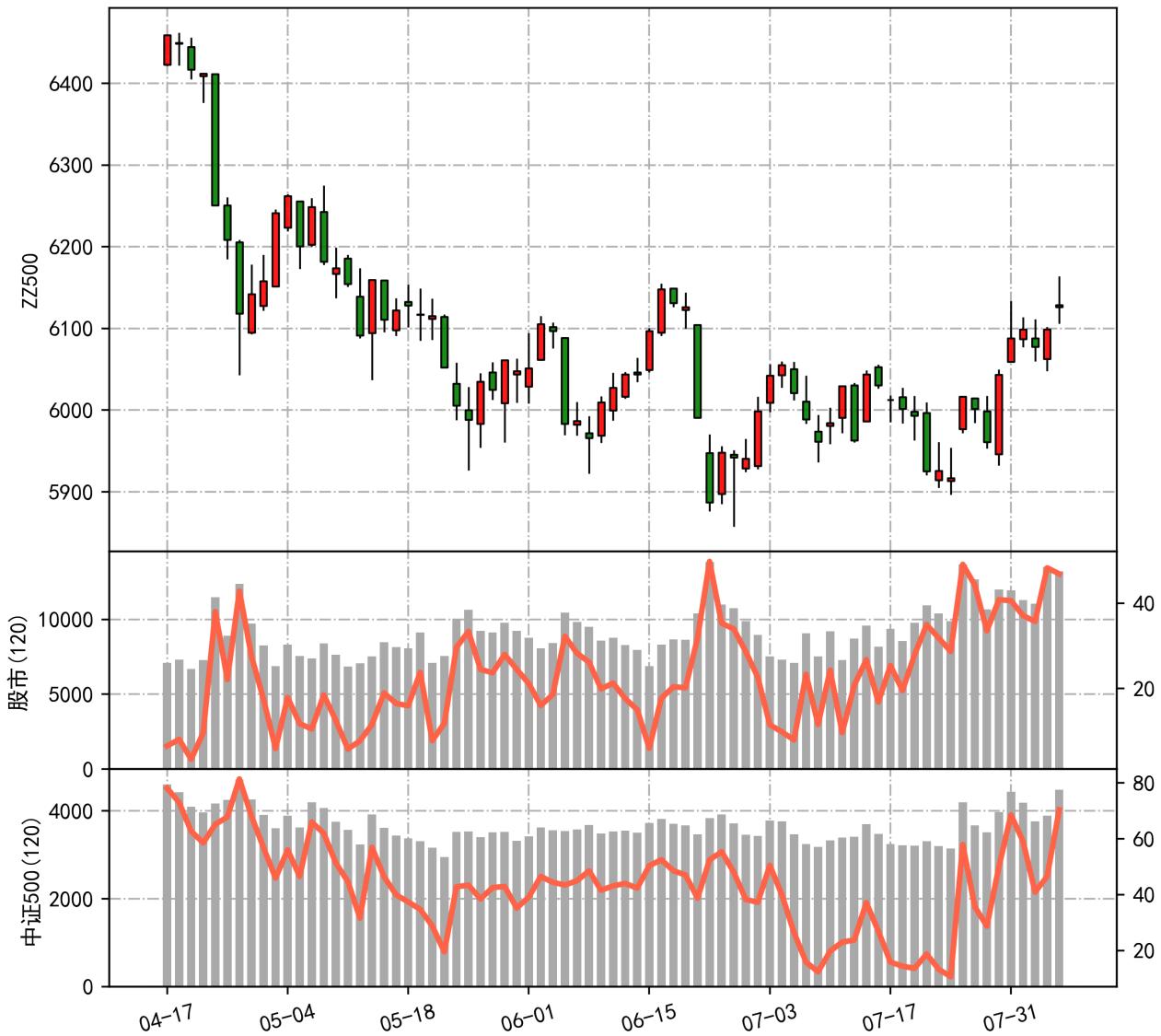


中证500

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: 13205 (**93.4**,46.9)
- 中证500: 4484 (**100.0**,70.4)



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: 85 (49.1,49.1); 53 (70.3,69.3); 30 (**90.9**,51.7);
- Low: 25 (**6.7,5.3**); 9 (**4.6,4.1**); 6 (**5.1,5.1**);



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: 13205 (**93.4**,46.9)
- 创业板指: 11514 (28.8,28.8)

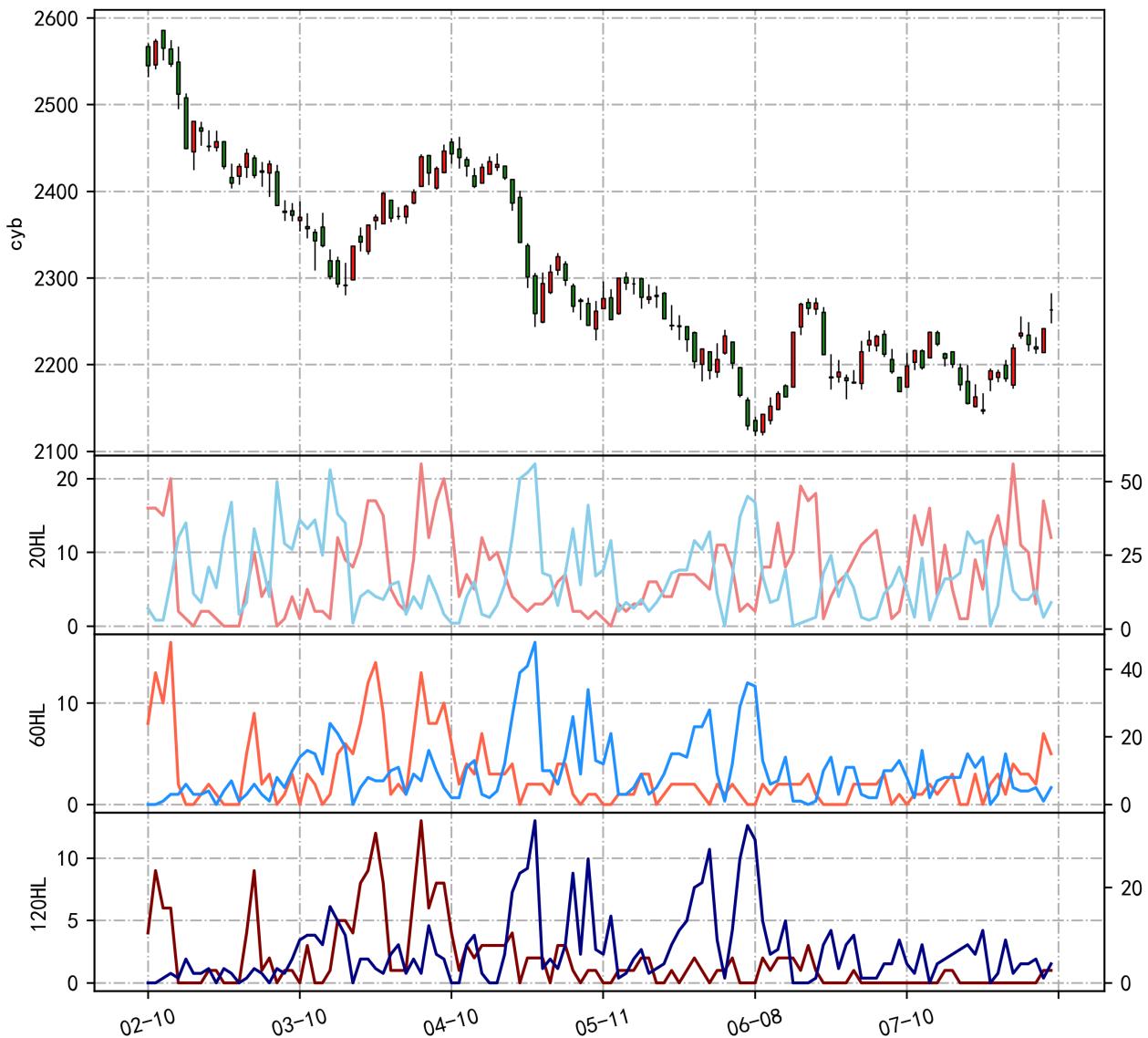


20-60-120日的新高新低数

- 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. cyb

- High: 12 (54.5,54.5); 5 (71.4,31.2); 1 (33.3,**7.7**);
- Low: 9 (**18.2,14.5**); 5 (**13.9,10.4**); 4 (**12.1,11.8**);



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: 13205 (**93.4**,46.9)
 2. 科创50: 2790 (73.1,71.4)

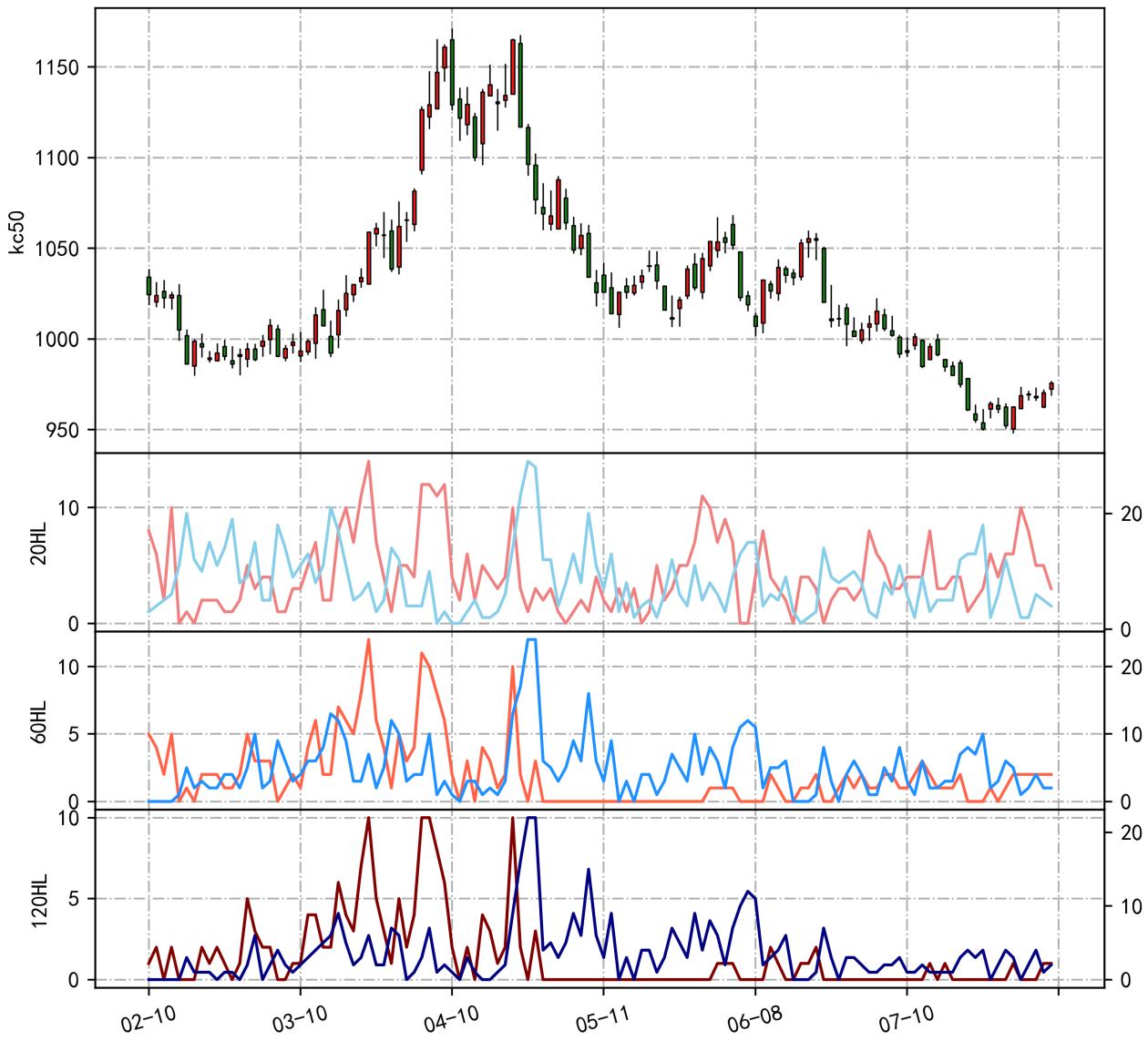


20-60-120日的新高新低数

- 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. kc50

- High: 3 (27.3, 21.4); 2 (66.7, **16.7**); 1 (50.0, **10.0**);
- Low: 4 (**17.6, 10.7**); 2 (**16.7, 8.3**); 2 (**16.7, 9.1**);



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: 1484 (22.6,22.6)
2. 恒生指数: 14975 (72.6,58.3)



恒生科技指数: 12916 (70.7,73.8)



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: 13279 (42.5, **4.6**)
 2. 道琼斯指数: 13049 (43.4, **9.6**)
 3. 纳斯达克指数: 9879 (65.0, 29.4)



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: 778 (25.1,21.0)

