

股指日报 (2023-07-14)

总括

恐慌指数 2023-07-14

- 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: 14.17 (43.2,35.0,38.4)
 2. 50ETF: 14.80 (40.1,34.6,42.2)



检索量波动 2023-07-14

- 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: 8179 (27.8, **16.8**)
 2. 股票: 41501 (**86.3,87.8**)
 3. a股: 9277 (**13.1**,21.9)
 4. 上证: 4619 (31.8,38.7)

5. 上证指数: 148201 (8.4,17.2)



新高新低分位 2023-07-14

- 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: 561 (47.0, **15.3**); 209 (38.9, **19.2**); 110 (**18.5,18.2**);
- Low: 242 (**4.6,6.8**); 100 (**2.3,3.6**); 72 (**3.8,5.0**);



北向资金流入 2023-07-14

- 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: 0.55 (**85.8**,25.1,43.1)



主要指数分析 2023-07-14

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: 14.17 (43.2,35.0,38.4)
2. 50ETF: 14.80 (40.1,34.6,42.2)



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: 8179 (27.8, **16.8**)
 2. 上证50: 1485 (27.5, 28.0)



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 (33.3,25.9); 1 (**8.3,5.9**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 3 (**10.7,10.7**); 1 (**5.0,5.0**); 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: 14.17 (43.2,35.0,38.4)
 2. 50ETF: 14.80 (40.1,34.6,42.2)



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: 8179 (27.8, **16.8**)
 2. 沪深300: 3990 (49.5,39.8)

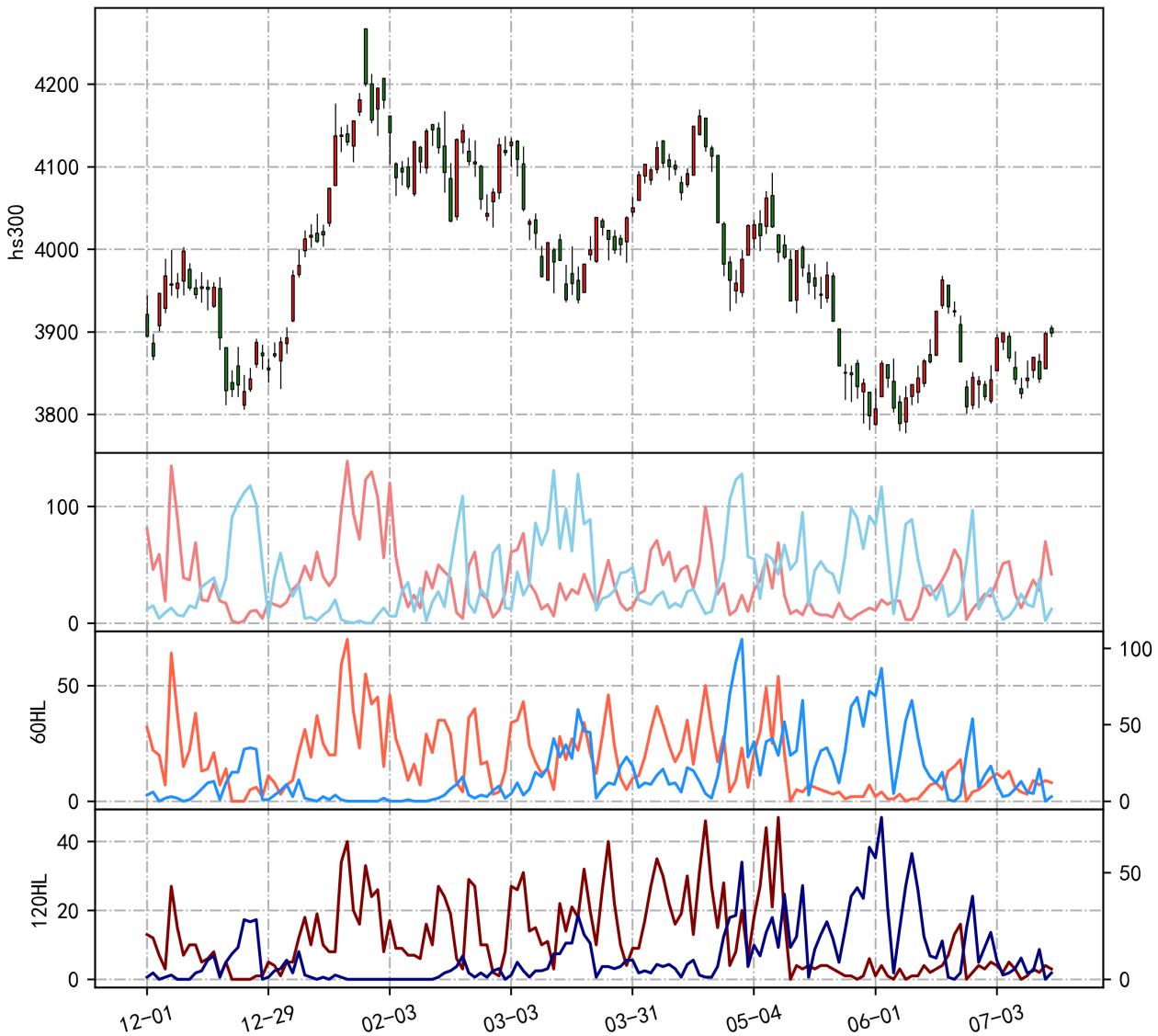


沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 42 (40.2,28.7); 8 (**14.8,11.4**); 3 (**6.4,6.4**);
- Low: 12 (**7.9,9.2**); 3 (**2.8,2.8**); 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: 8179 (27.8, **16.8**)
- 中证500: 3476 (34.9, 26.9)

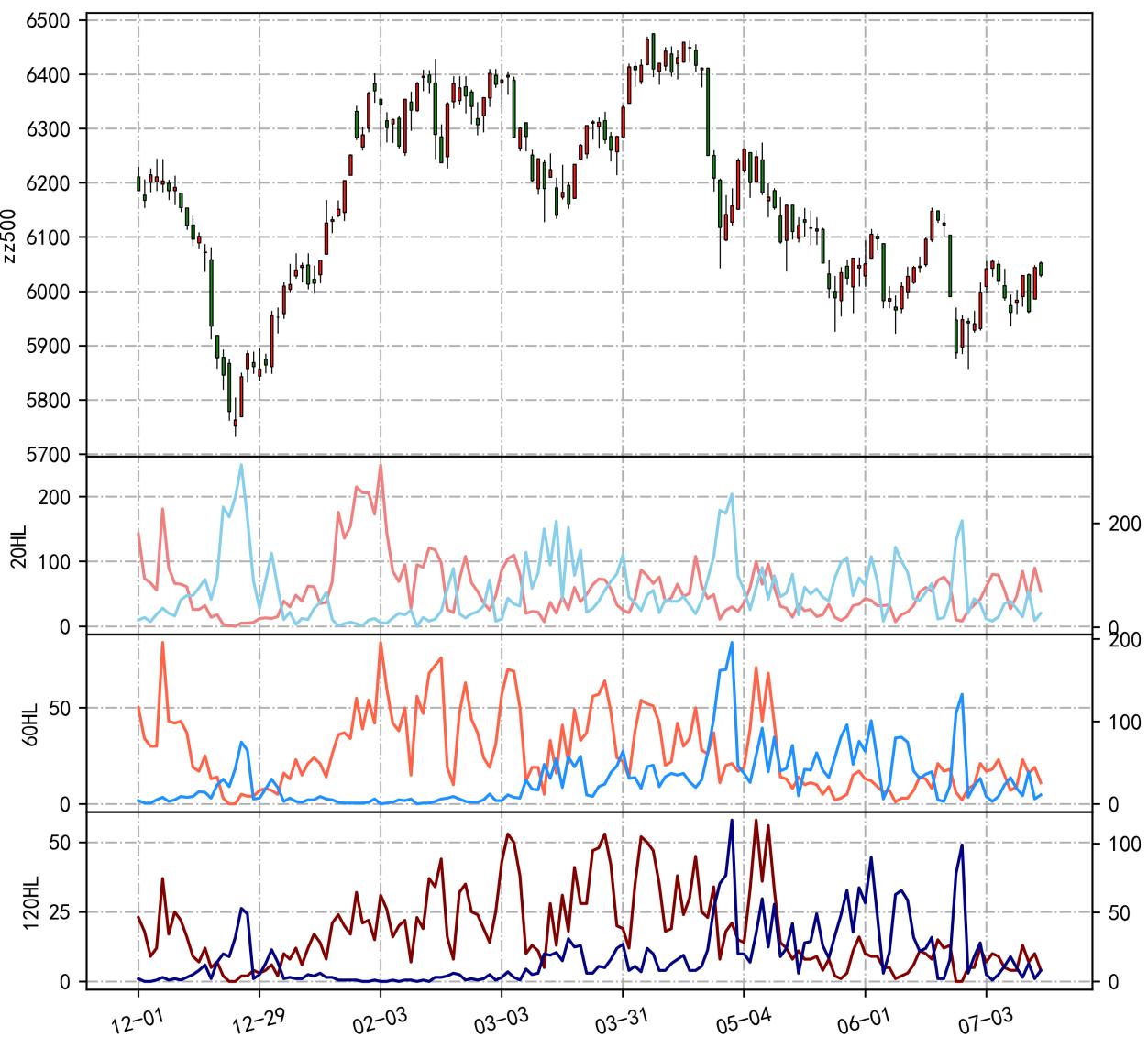


20-60-120日的新高新低数

- 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. zz500

- High: 54 (46.5, **19.4**); 11 (**14.3, 12.0**); 4 (**6.9, 6.9**);
- Low: 27 (**6.1, 9.8**); 11 (**4.1, 5.6**); 8 (**6.0, 6.8**);



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

- 股市: 8179 (27.8, **16.8**)
- 创业板指: 11400 (26.4, 29.2)

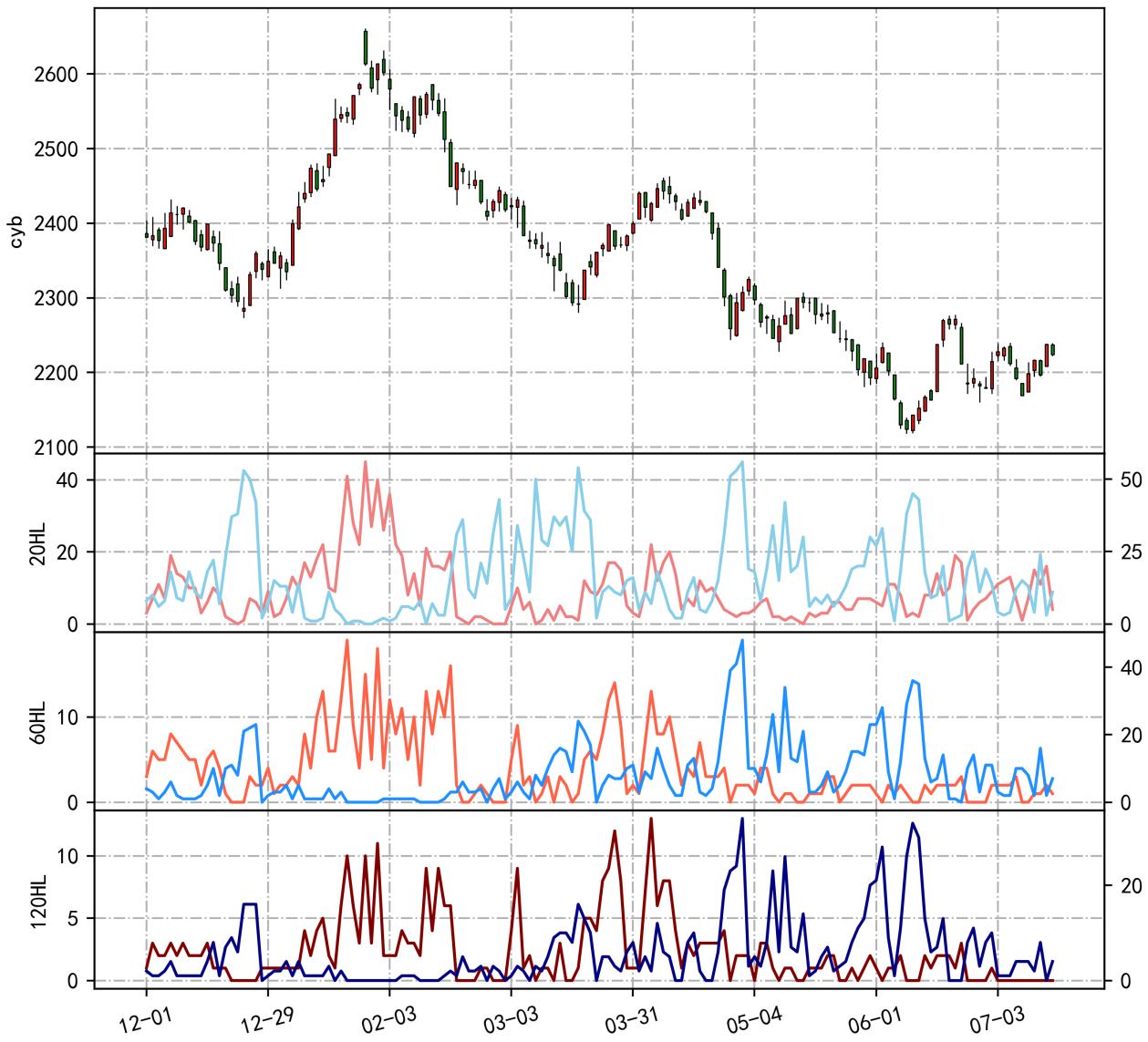


20-60-120日的新高新低数

- 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: 4 (21.1, **8.9**); 1 (**14.3, 5.3**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 11 (**18.2, 19.6**); 7 (**14.6, 14.6**); 4 (**11.8, 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

- 股市: 8179 (27.8, **16.8**)
- 科创50: 2522 (49.0, 64.3)

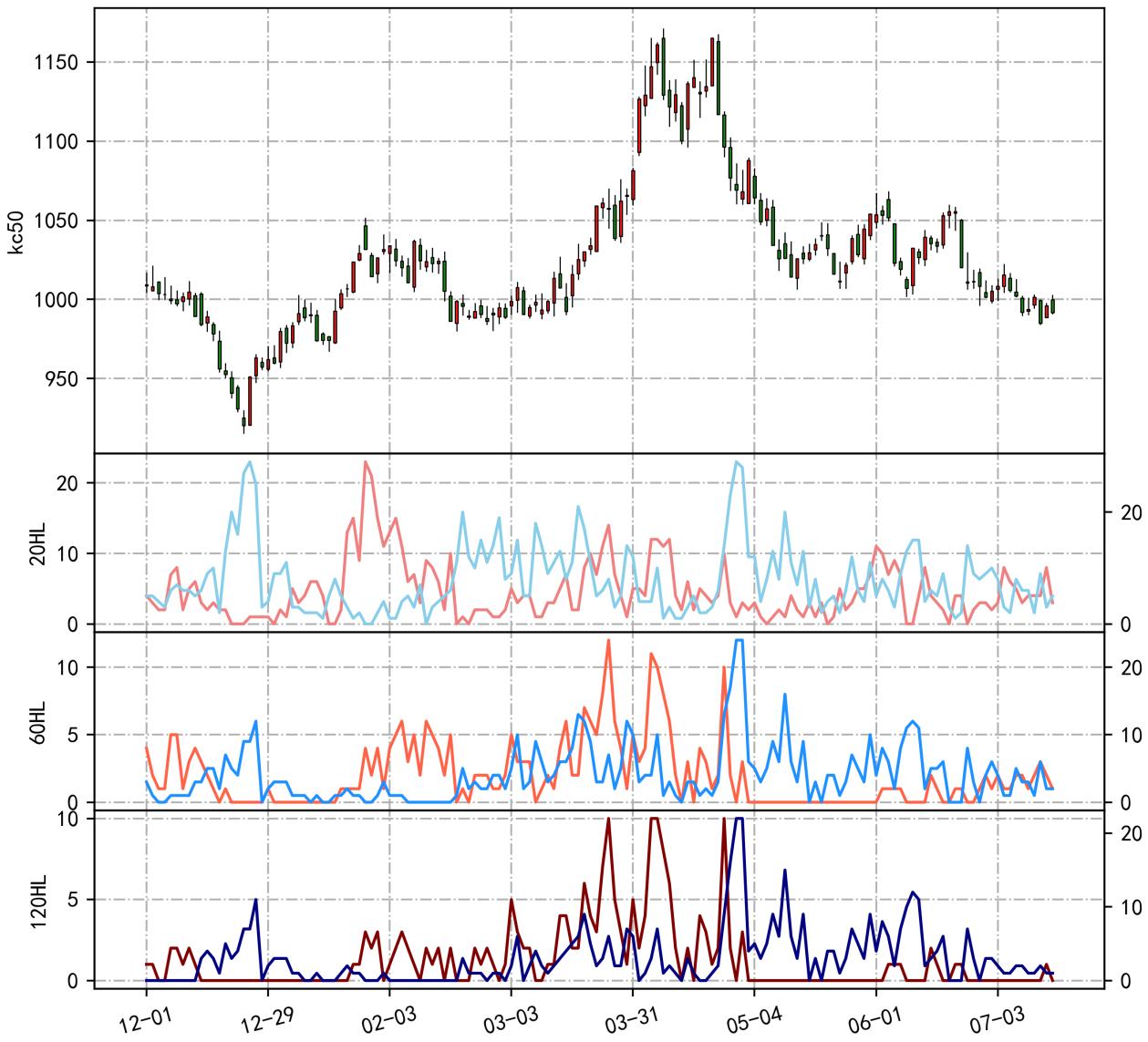


20-60-120日的新高新低数

- 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. kc50

- High: 3 (27.3, **13.0**); 1 (**10.0,8.3**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 5 (**14.3,17.2**); 2 (**8.3,8.3**); 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: 1263 (**12.4,10.0**)
 2. 恒生指数: 17232 (**90.8,72.8**)



恒生科技指数: 12110 (**87.8,88.1**)



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: 13610 (32.6, **6.5**)
 2. 道琼斯指数: 12877 (31.6, **6.1**)
 3. 纳斯达克指数: 9674 (61.7, 25.6)

