

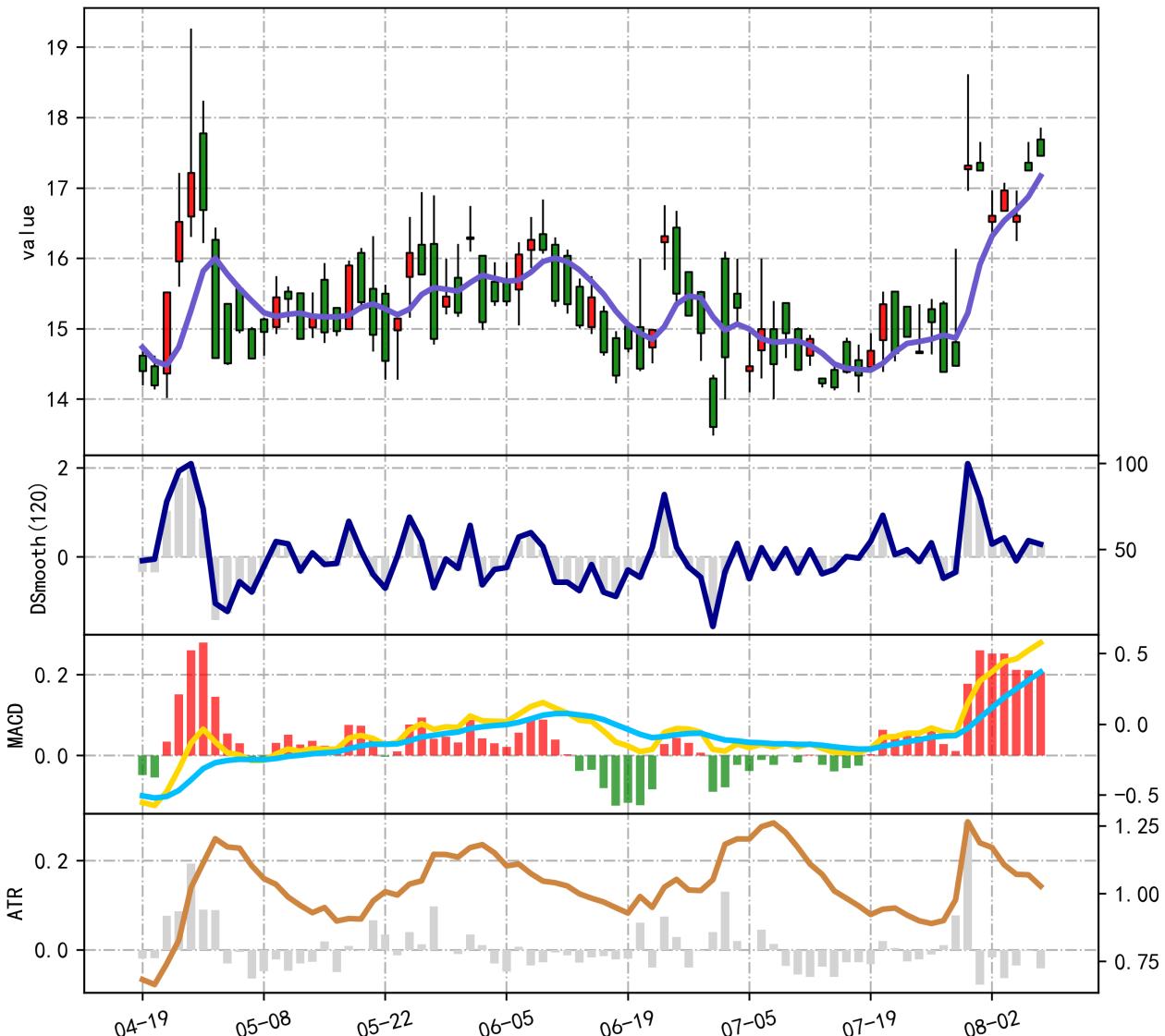
股指日报 (2023-08-09)

总括

恐慌指数 2023-08-08

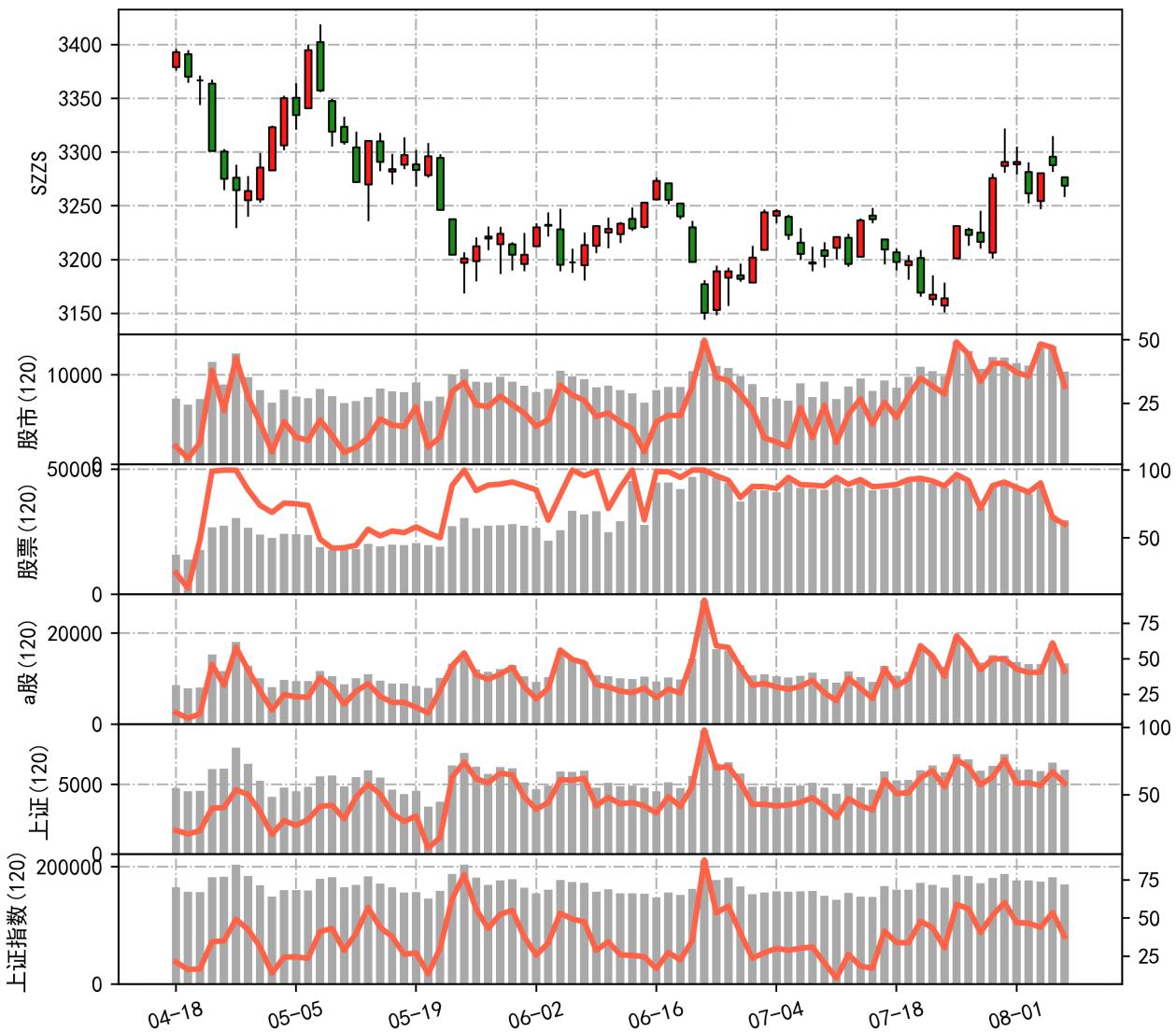
- 选用沪深**300ETF**期权波动率指数作为整个市场恐慌指数的表征
- 其后另附上证**50ETF**、中证**500ETF**等的期权波动率指数
- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

1. 300ETF: 17.46 (31.0,50.6,53.1)
2. 50ETF: 18.78 (26.1,38.1,41.4)



检索量波动 2023-08-07

- 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: 10370 (58.8,31.7)
 2. 股票: 29656 (49.6,60.1)
 3. a股: 13390 (42.5,41.6)
 4. 上证: 6031 (59.7,58.3)
 5. 上证指数: 169878 (43.7,37.8)



1. 牛市: 554 (41.1,41.1)

2. 熊市: 294 (54.4,44.6)



新高新低分位 2023-08-08

- 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: 213 (**4.4,5.1**); 109 (**6.9,6.4**); 54 (**2.8,1.5**);
- Low: 742 (32.4,22.3); 250 (21.0,**9.2**); 156 (**17.5,11.2**);



北向资金流入 2023-08-09

- 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: 0.61 (51.4,40.1,43.9)



主要指数分析 2023-08-07

包括内地宽基指数、港股指数等

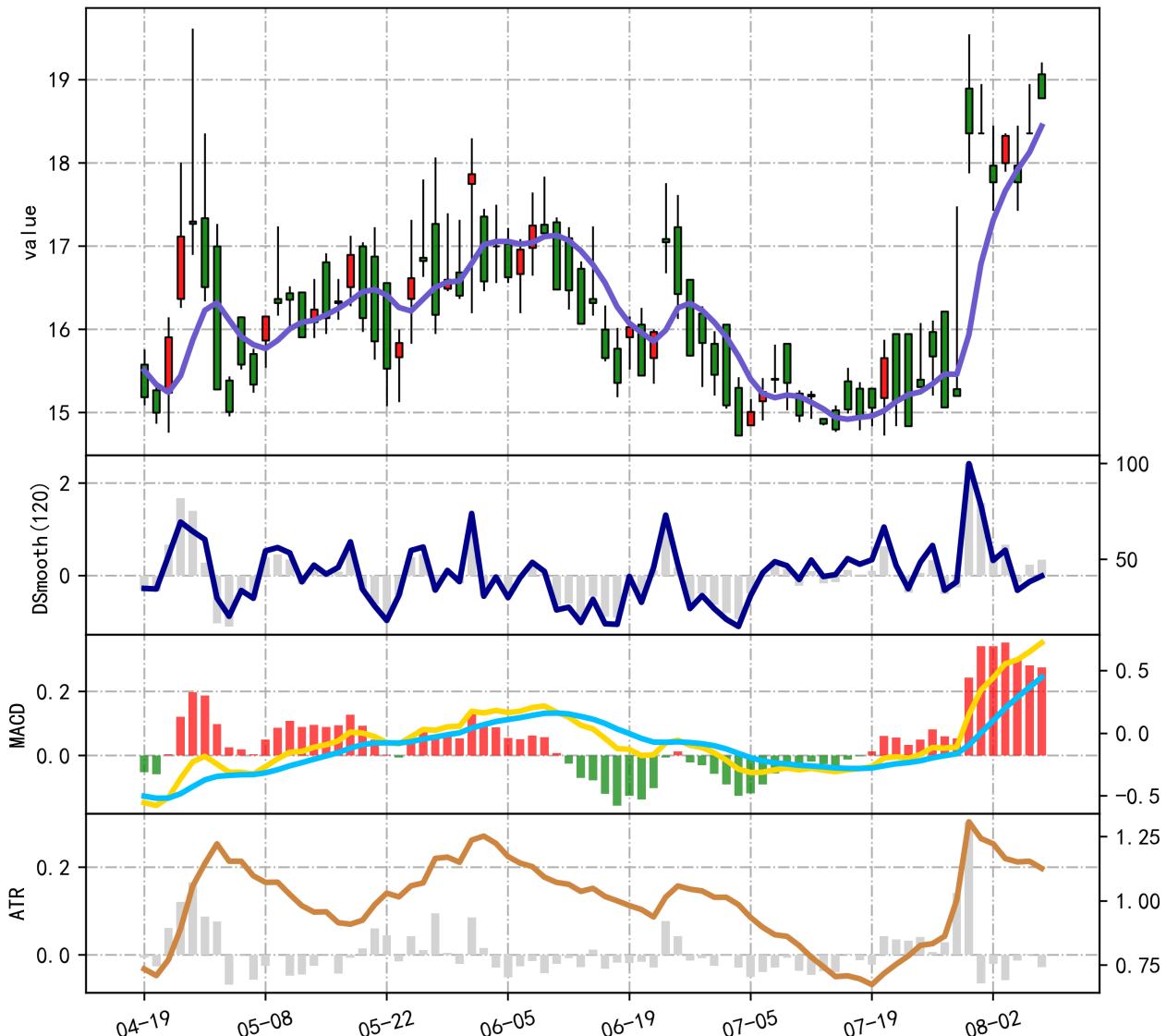
上证50

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: 17.46 (31.0,50.6,53.1)

2. 50ETF: 18.78 (26.1,38.1,41.4)



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: 10370 (58.8,31.7)
 - 上证50: 1600 (39.1,40.4)



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

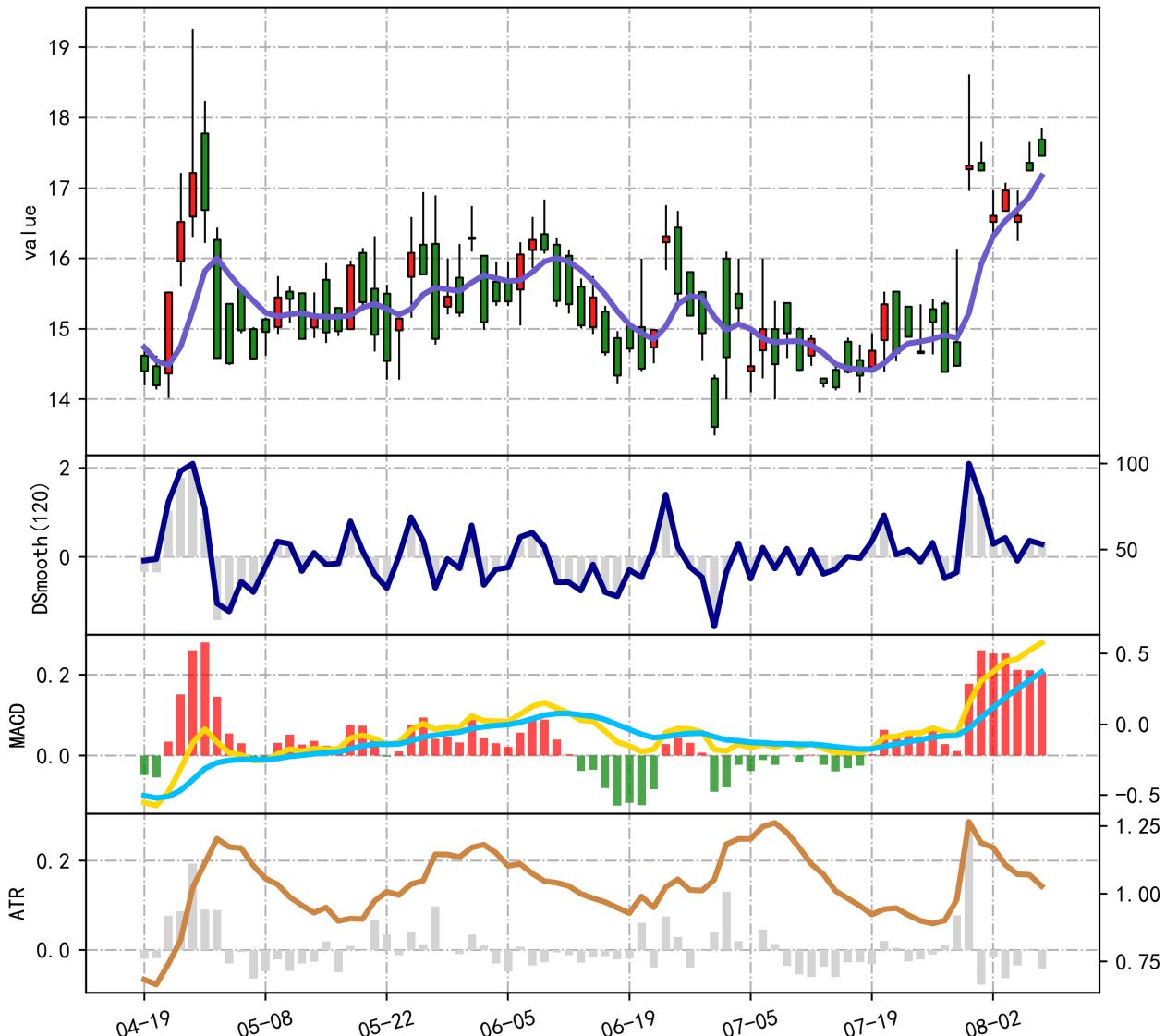
- High: 4 (**19.0, 19.0**); 2 (22.2, **16.7**); 2 (50.0, **20.0**);
- Low: 3 (**10.7, 10.7**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);



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: 17.46 (31.0,50.6,53.1)
 2. 50ETF: 18.78 (26.1,38.1,41.4)



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: 10370 (58.8,31.7)
 - 沪深300: 3907 (29.4,29.4)



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: 21 (**13.1,13.1**); 11 (22.0,20.4); 8 (38.1,**17.0**);
- Low: 26 (20.9,**18.6**); 6 (**6.9,5.7**); 5 (**6.6,6.6**);



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: 10370 (58.8,31.7)
- 中证500: 3848 (63.5,44.7)



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: 31 (**15.1, 15.1**); 18 (23.0, 22.7); 4 (**12.1, 6.9**);
- Low: 59 (24.4, **19.3**); 25 (**16.9, 11.9**); 15 (**14.3, 12.1**);



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: 10370 (58.8,31.7)
- 创业板指: 10032 (**0.0,0.0**)

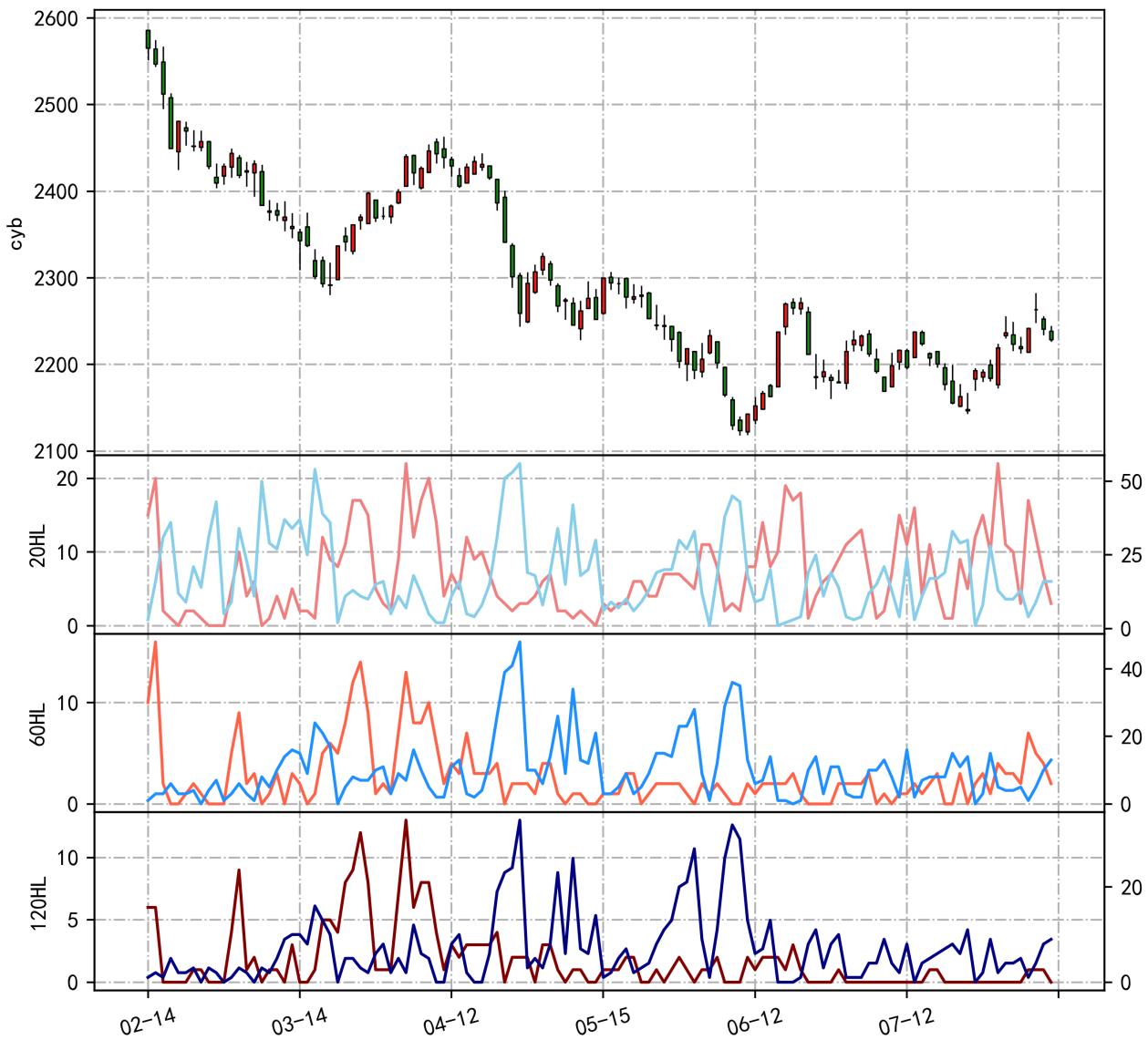


20-60-120日的新高新低数

- 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: 3 (**9.5, 13.6**); 2 (28.6, **12.5**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 16 (34.1, 27.3); 13 (36.1, 27.1); 9 (27.3, 26.5);



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: 10370 (58.8,31.7)
 2. 科创50: 2526 (46.9,47.3)

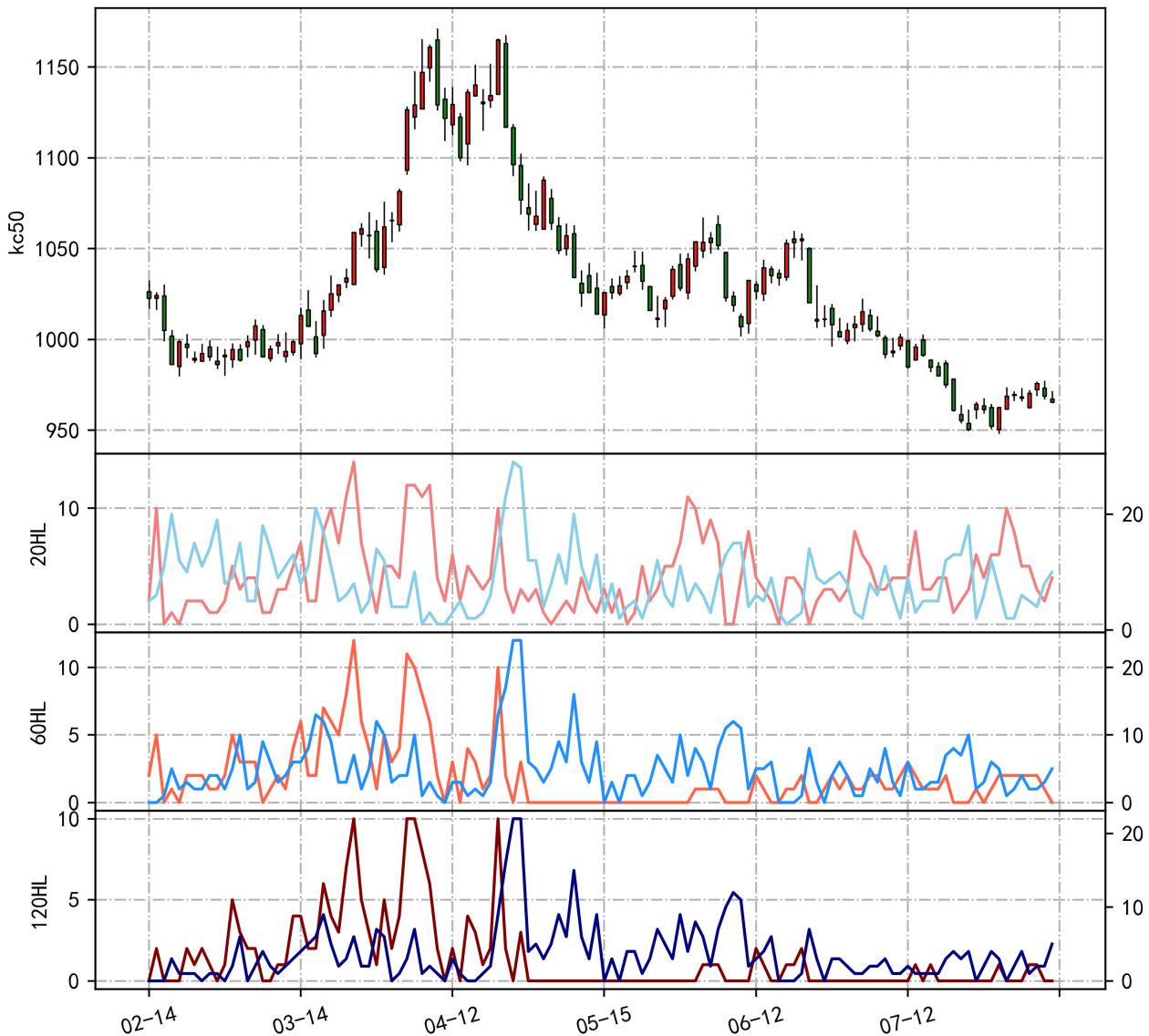


20-60-120日的新高新低数

- 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: 4 (36.4,28.6); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 10 (52.9,32.1); 5 (41.7,20.8); 5 (41.7,22.7);



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: 1662 (32.4,32.4)
2. 恒生指数: 14989 (72.8,58.4)



恒生科技指数: 10702 (46.6,52.5)



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: 7440 (**0.0,0.0**)
2. 道琼斯指数: 6521 (**0.0,0.0**)
3. 纳斯达克指数: 5371 (**0.0,0.0**)



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: 826 (38.6,32.2)

