

股指日报 (2023-08-10)

总括

恐慌指数 2023-08-08

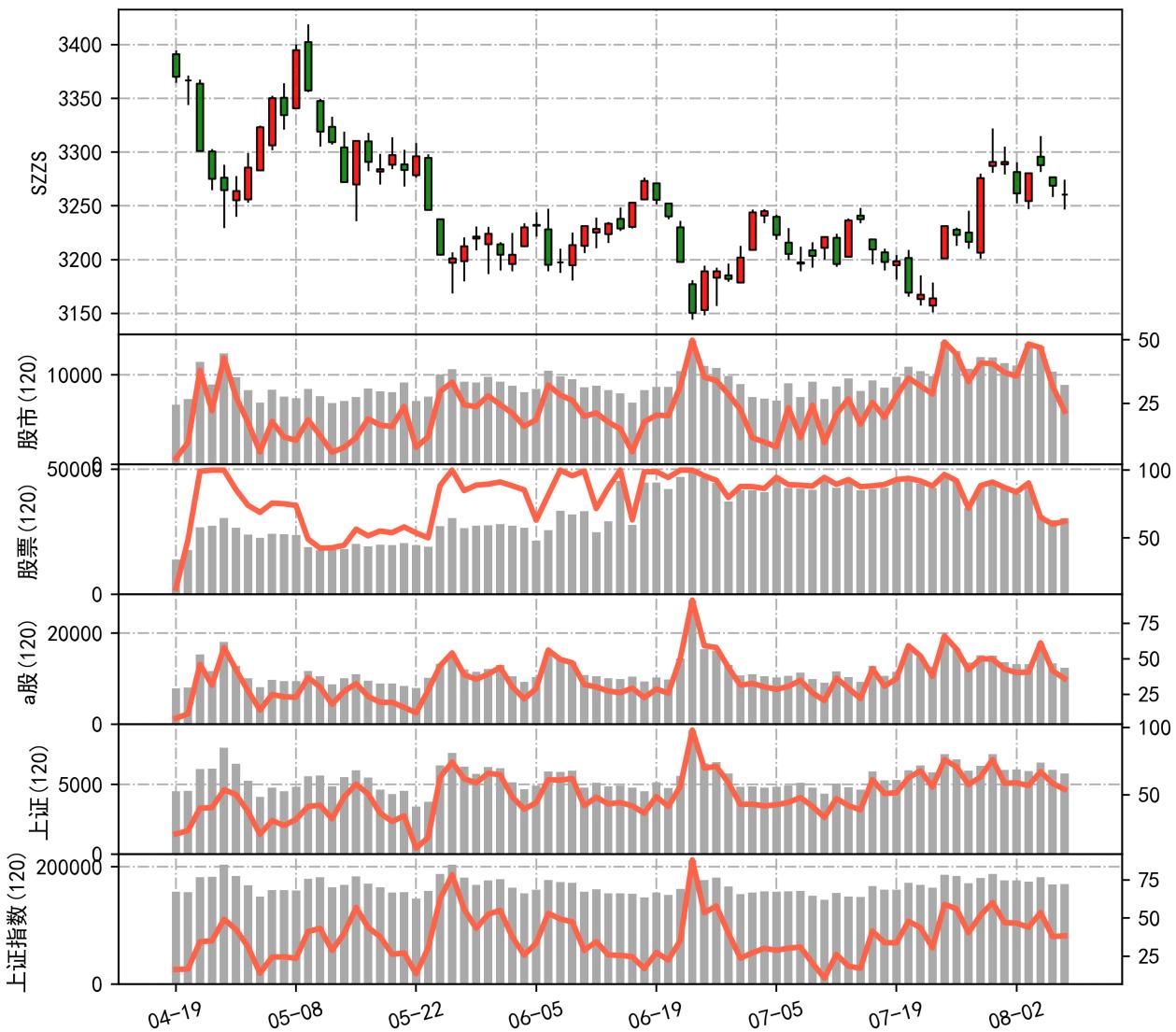
- 选用沪深**300ETF**期权波动率指数作为整个市场恐慌指数的表征
- 其后另附上证**50ETF**、中证**500ETF**等的期权波动率指数
- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

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 2023-08-08

- 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: 8870 (36.4,21.9)
 2. 股票: 30489 (49.7,62.3)
 3. a股: 12352 (36.0,35.9)
 4. 上证: 5781 (55.2,54.0)
 5. 上证指数: 170304 (44.4,38.4)



1. 牛市: 560 (42.1,42.1)

2. 熊市: 248 (**19.8,16.2**)



新高新低分位 2023-08-09

- 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: 185 (**2.0,2.7**); 84 (**2.9,2.7**); 30 (**0.0,0.0**);
- Low: 1329 (62.3,41.5); 360 (31.5, **13.4**); 164 (**18.5,11.8**);



北向资金流入 2023-08-10

- 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: 0.49 (47.1,41.9,42.2)



主要指数分析 2023-08-08

包括内地宽基指数、港股指数等

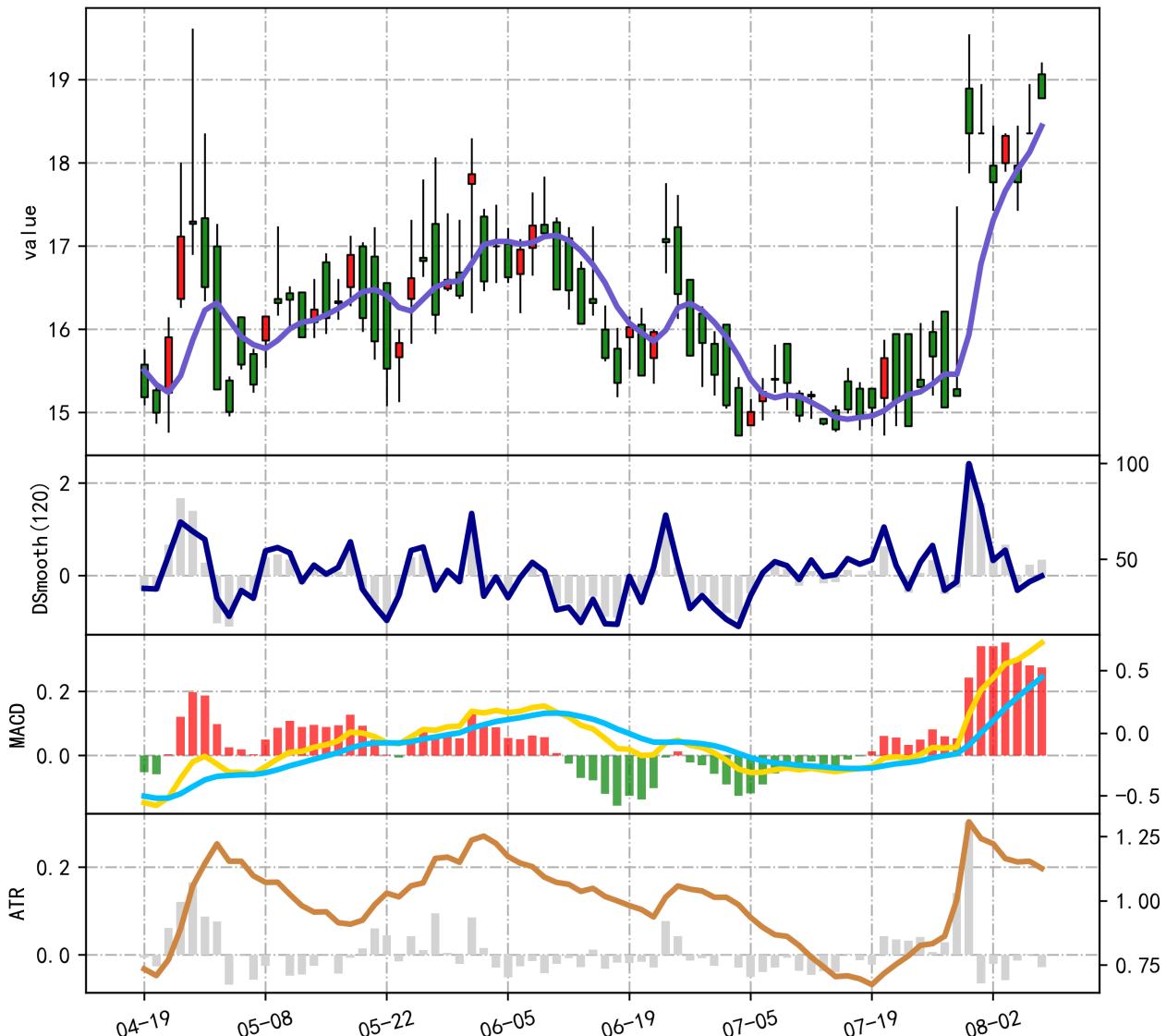
上证50

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
1. 股市: 8870 (36.4,21.9)
 2. 上证50: 1563 (35.0,36.3)



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. sz50

- High: 2 (**9.5,9.5**); 1 (**11.1,8.3**); 1 (25.0, **10.0**);
- 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
1. 股市: 8870 (36.4,21.9)
 2. 沪深300: 3931 (30.6,30.6)

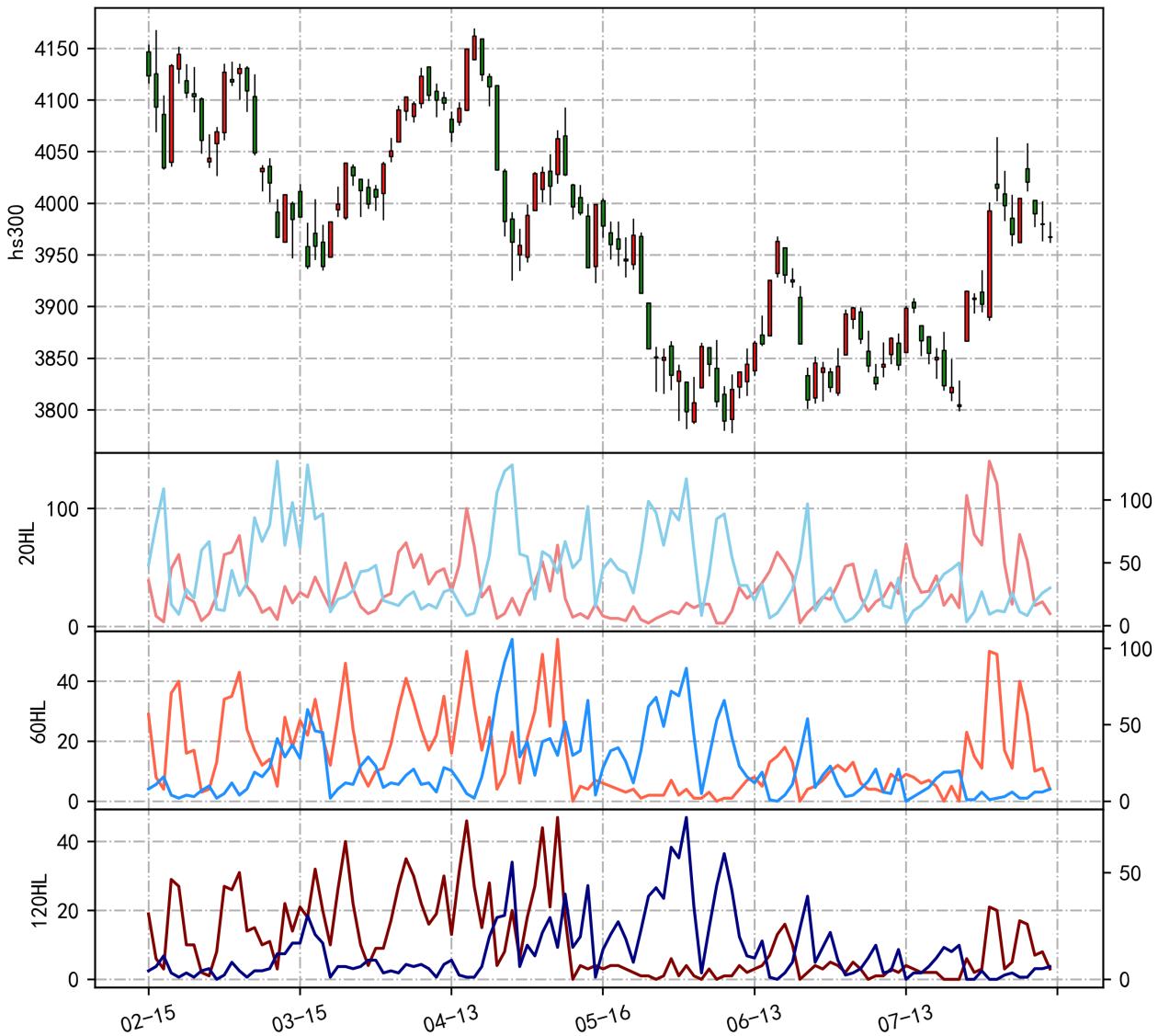


沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 11 (**5.8,5.8**); 4 (**8.0,7.4**); 3 (**14.3,6.4**);
- Low: 30 (24.3,21.7); 8 (**9.2,7.5**); 6 (**7.9,7.9**);



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: 8870 (36.4,21.9)
- 中证500: 3515 (41.9,29.5)

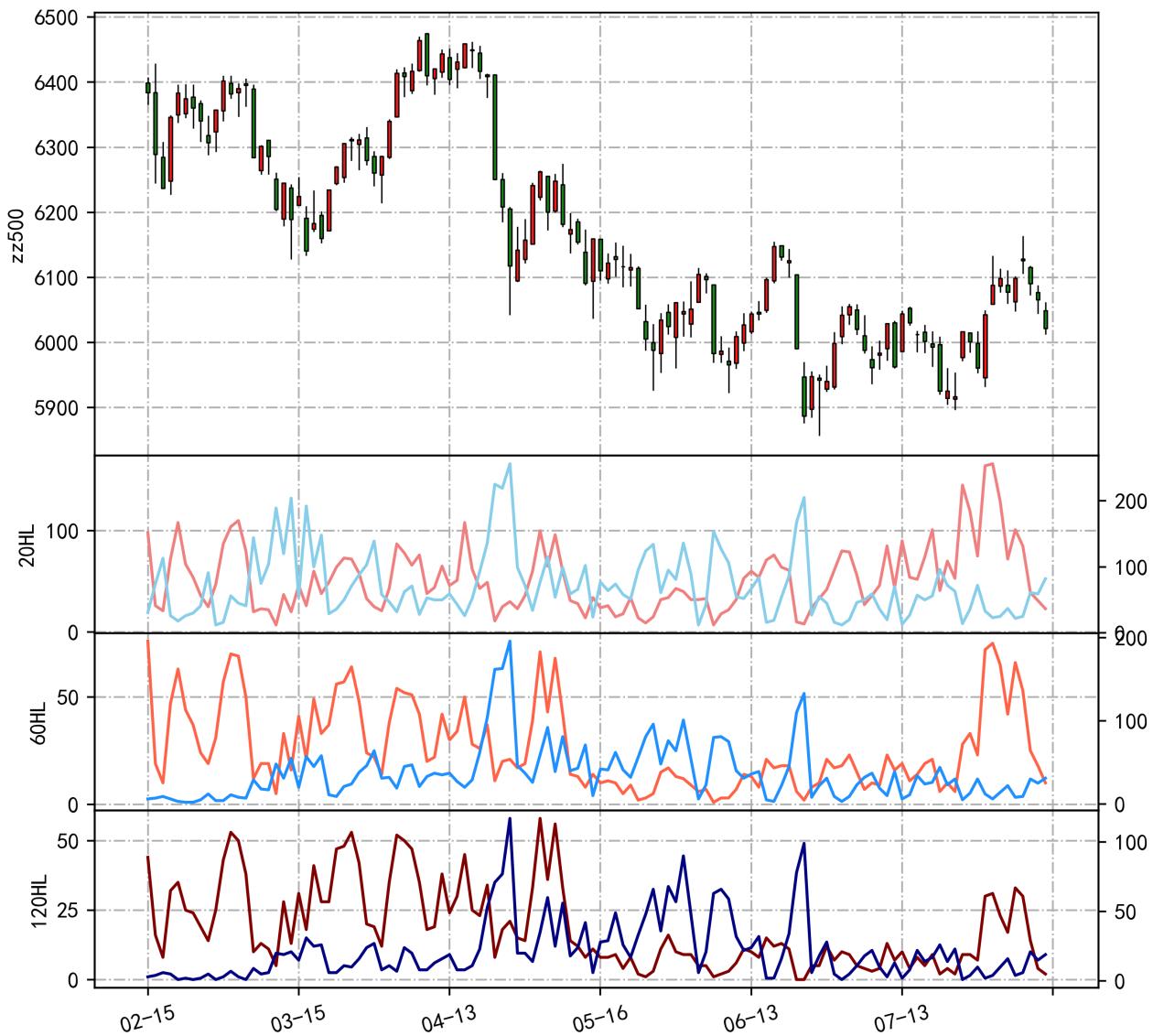


20-60-120日的新高新低数

- 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: 23 (**10.1, 10.1**); 10 (**12.2, 12.0**); 2 (**6.1, 3.4**);
- Low: 82 (36.3, 28.7); 31 (21.5, **14.9**); 19 (**18.4, 15.5**);



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: 8870 (36.4,21.9)
 2. 创业板指: 10494 (**10.2,10.2**)

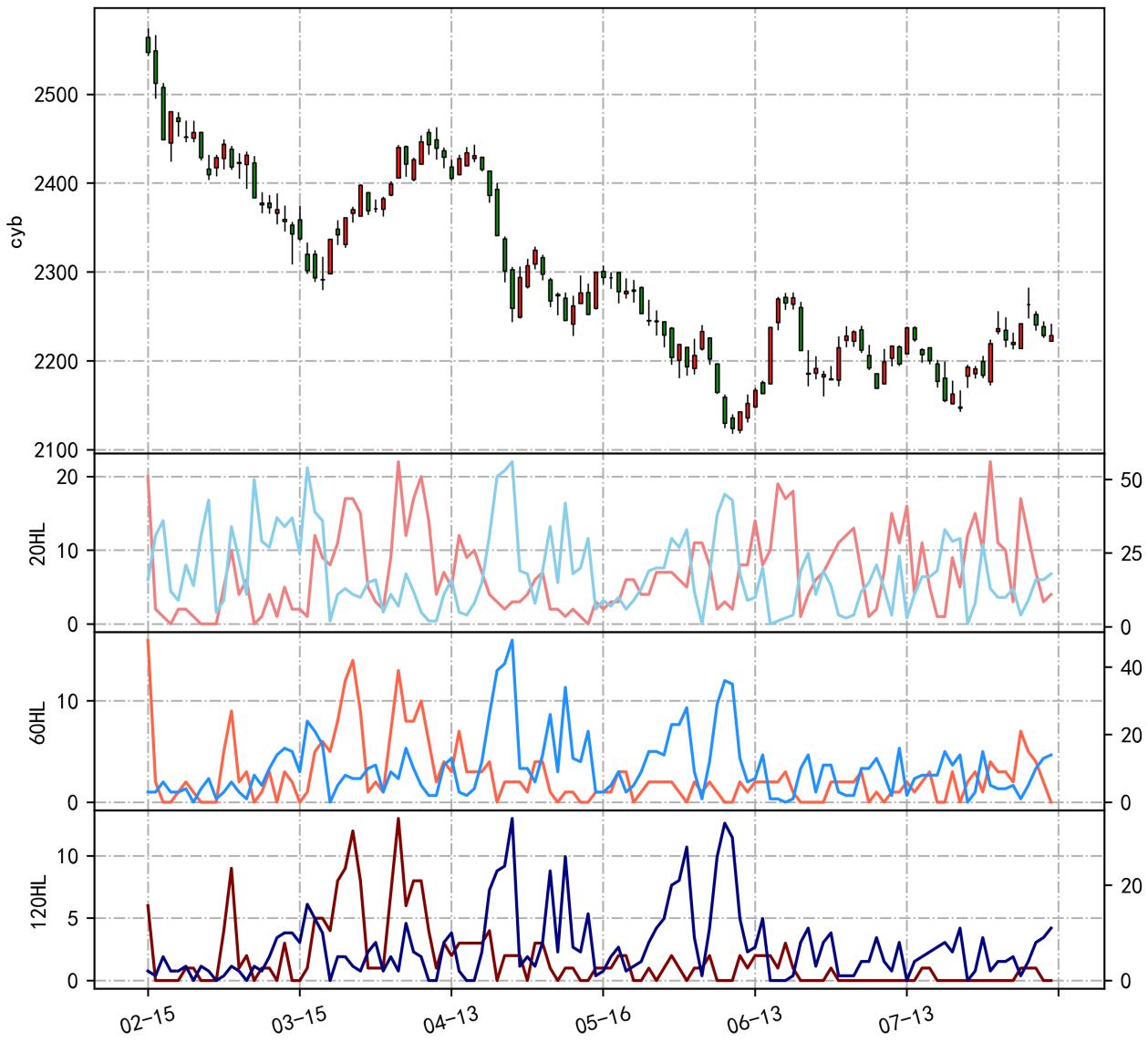


20-60-120日的新高新低数

- 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 (**14.3, 18.2**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 18 (38.6,30.9); 14 (38.9,29.2); 11 (33.3,32.4);



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: 8870 (36.4,21.9)
 2. 科创50: 2488 (42.9,45.0)

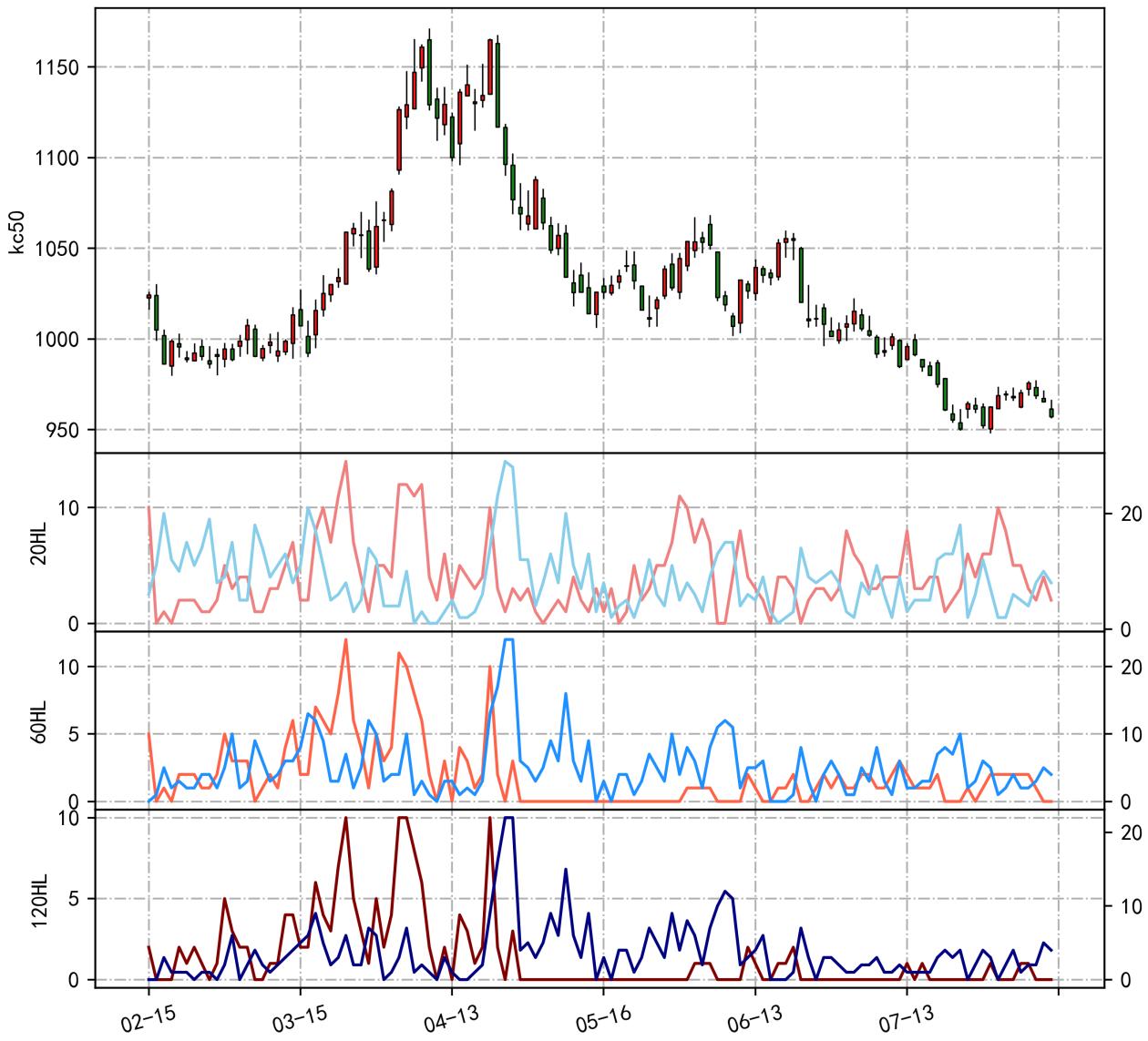


20-60-120日的新高新低数

- 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. kc50

- High: 2 (**18.2, 14.3**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 8 (41.2, 25.0); 4 (33.3, **16.7**); 4 (33.3, **18.2**);



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: 1694 (34.0,34.0)
2. 恒生指数: 14853 (71.5,57.4)



恒生科技指数: 10352 (41.9,48.6)



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: 14141 (57.2, **11.8**)
 2. 道琼斯指数: 13702 (54.0, **15.3**)
 3. 纳斯达克指数: 9876 (65.5, 30.0)



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: 807 (33.3,27.9)

