

股指日报 (2023-08-08)

总括

恐慌指数 2023-08-03

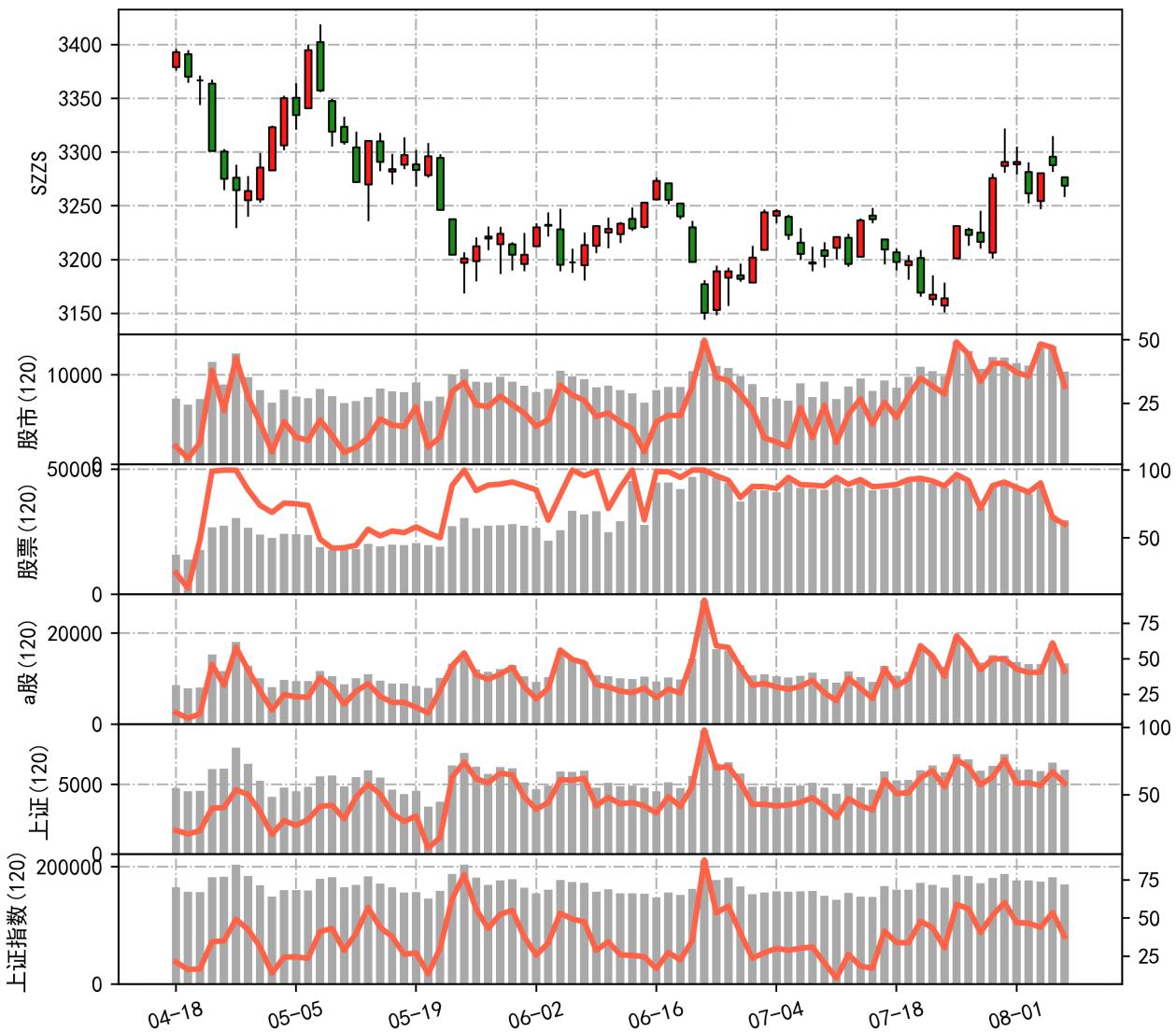
- 选用沪深**300ETF**期权波动率指数作为整个市场恐慌指数的表征
- 其后另附上证**50ETF**、中证**500ETF**等的期权波动率指数
- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

1. 300ETF: 16.97 (36.5,54.6,56.9)
2. 50ETF: 18.33 (37.8,47.9,54.9)



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
- 股市: 10370 (58.8,31.7)
 - 股票: 29656 (49.6,60.1)
 - a股: 13390 (42.5,41.6)
 - 上证: 6031 (59.7,58.3)
 - 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 2023-08-07

- 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: 253 (**7.9,6.5**); 138 (**11.6,9.7**); 79 (**16.7,9.0**);
- Low: 904 (40.7,28.1); 263 (22.2,**10.0**); 164 (**18.5,12.0**);



北向资金流入 2023-08-08

- 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: 0.99 (66.1,51.3,49.4)



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: 16.97 (36.5,54.6,56.9)

2. 50ETF: 18.33 (37.8,47.9,54.9)



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: 10370 (58.8,31.7)
 2. 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

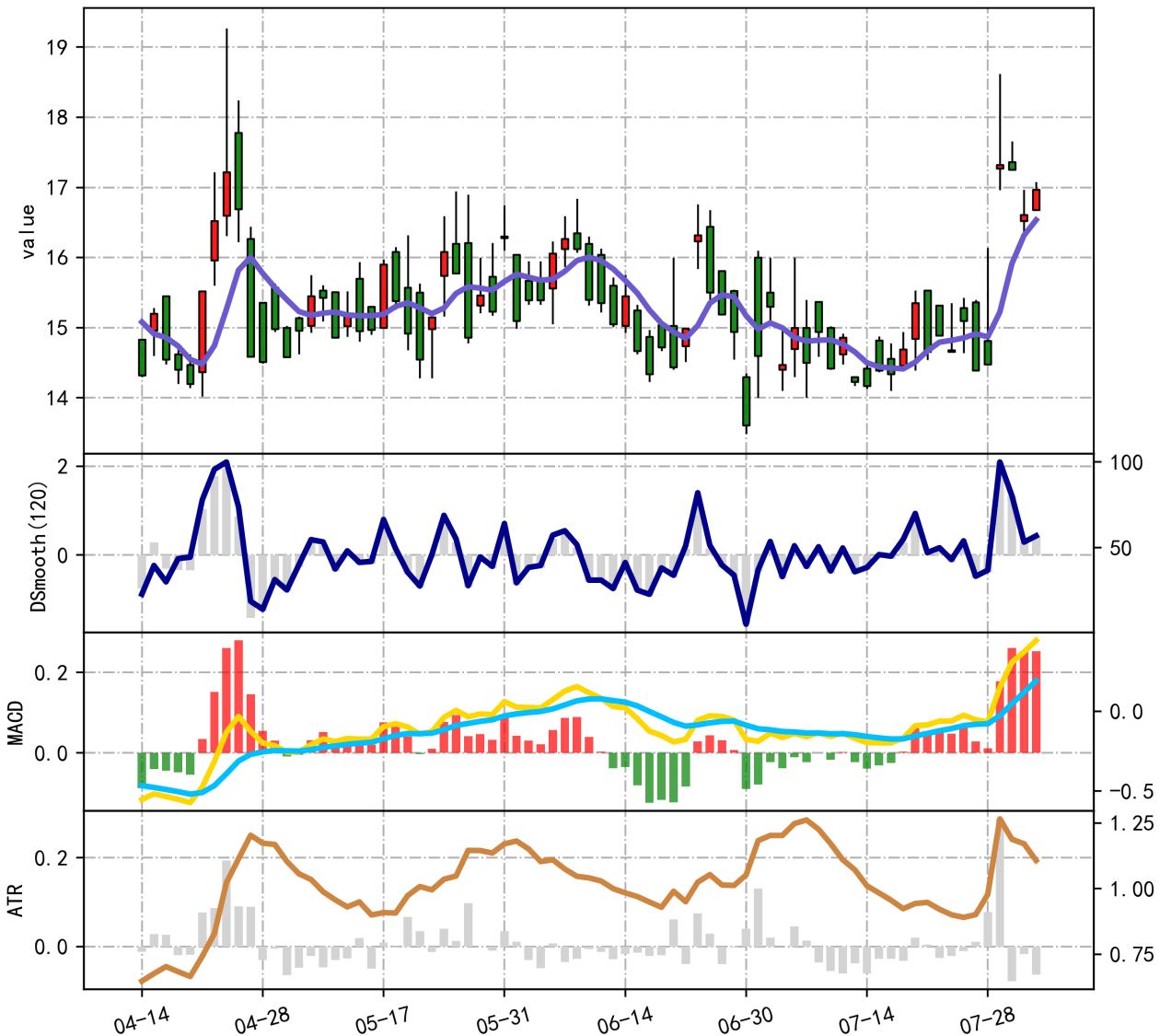
- High: 3 (**14.3, 14.3**); 1 (**11.1, 8.3**); 1 (25.0, **10.0**);
- Low: 4 (**14.3, 14.3**); 1 (**5.0, 5.0**); 1 (**5.6, 5.6**);



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: 16.97 (36.5,54.6,56.9)
 2. 50ETF: 18.33 (37.8,47.9,54.9)



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)

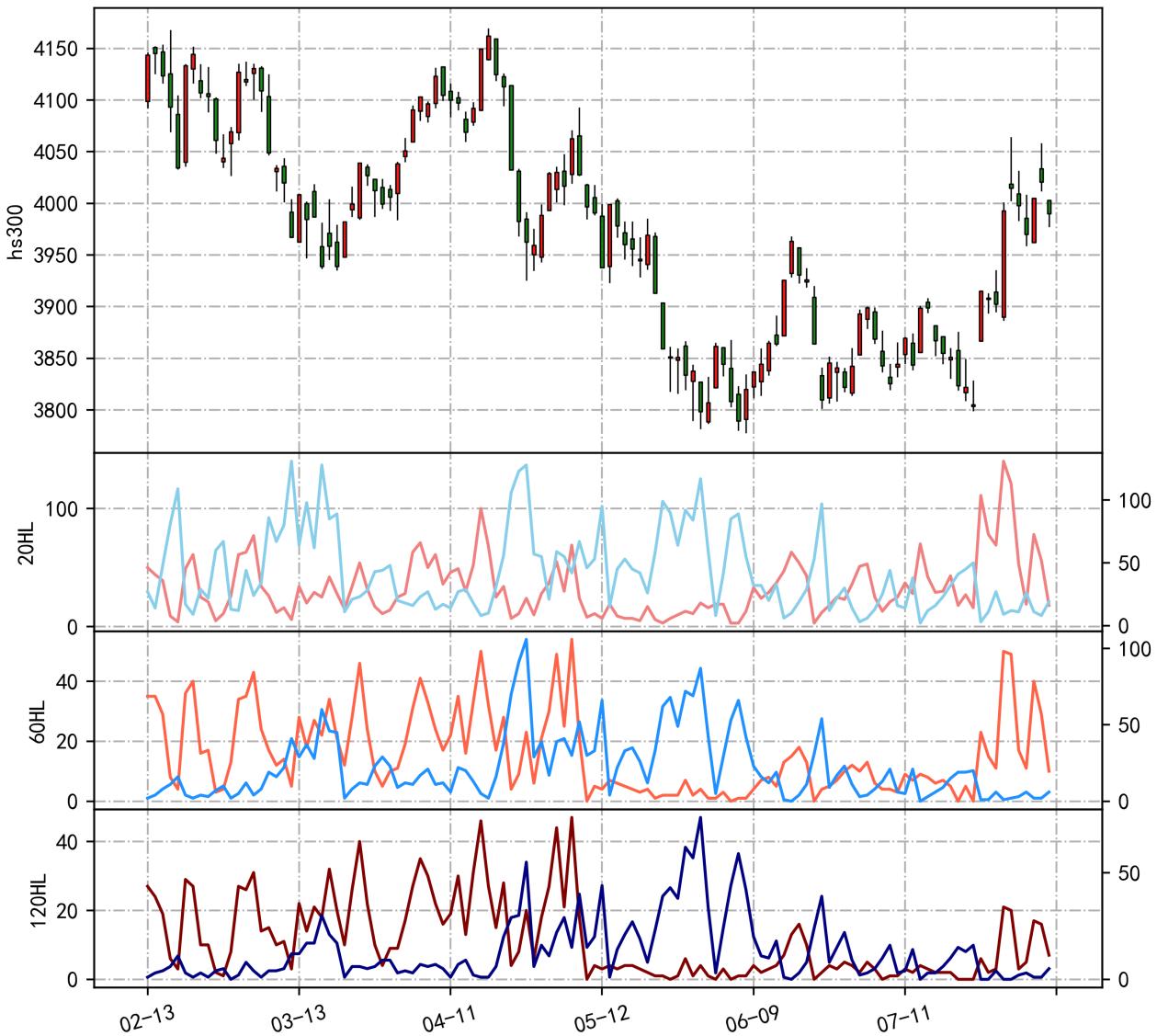


沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 18 (**10.9, 10.9**); 10 (**20.0, 18.5**); 7 (33.3, **14.9**);
- Low: 19 (**14.8, 13.2**); 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: 39 (20.1,20.1); 25 (32.4,32.0); 14 (42.4,24.1);
- Low: 61 (25.4,20.1); 30 (20.8, **14.9**); 21 (20.4, **17.9**);



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

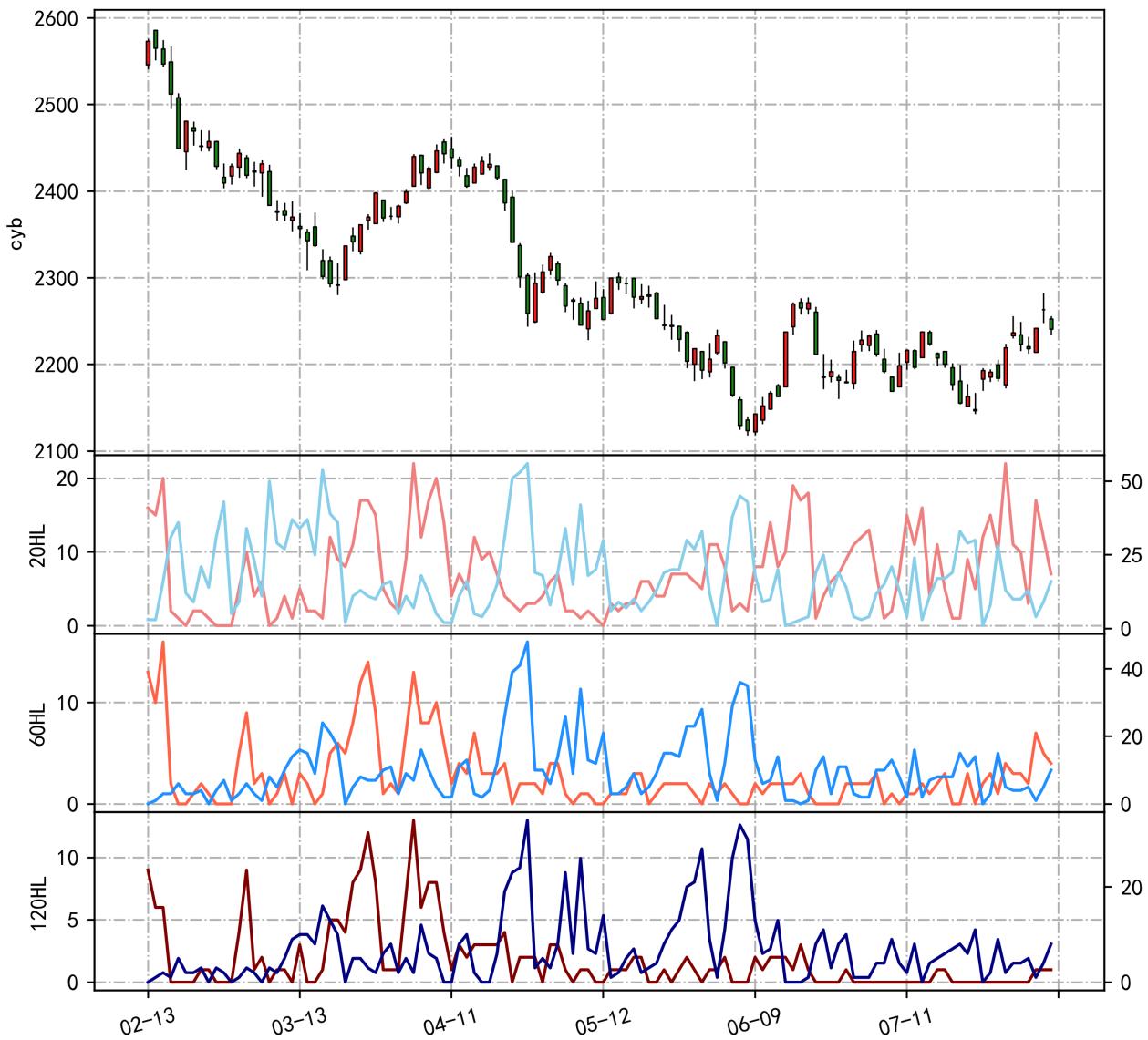


20-60-120日的新高新低数

- 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: 7 (31.8,31.8); 4 (57.1,25.0); 1 (33.3,**7.7**);
- Low: 16 (34.1,27.3); 10 (27.8,20.8); 8 (24.2,23.5);



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)

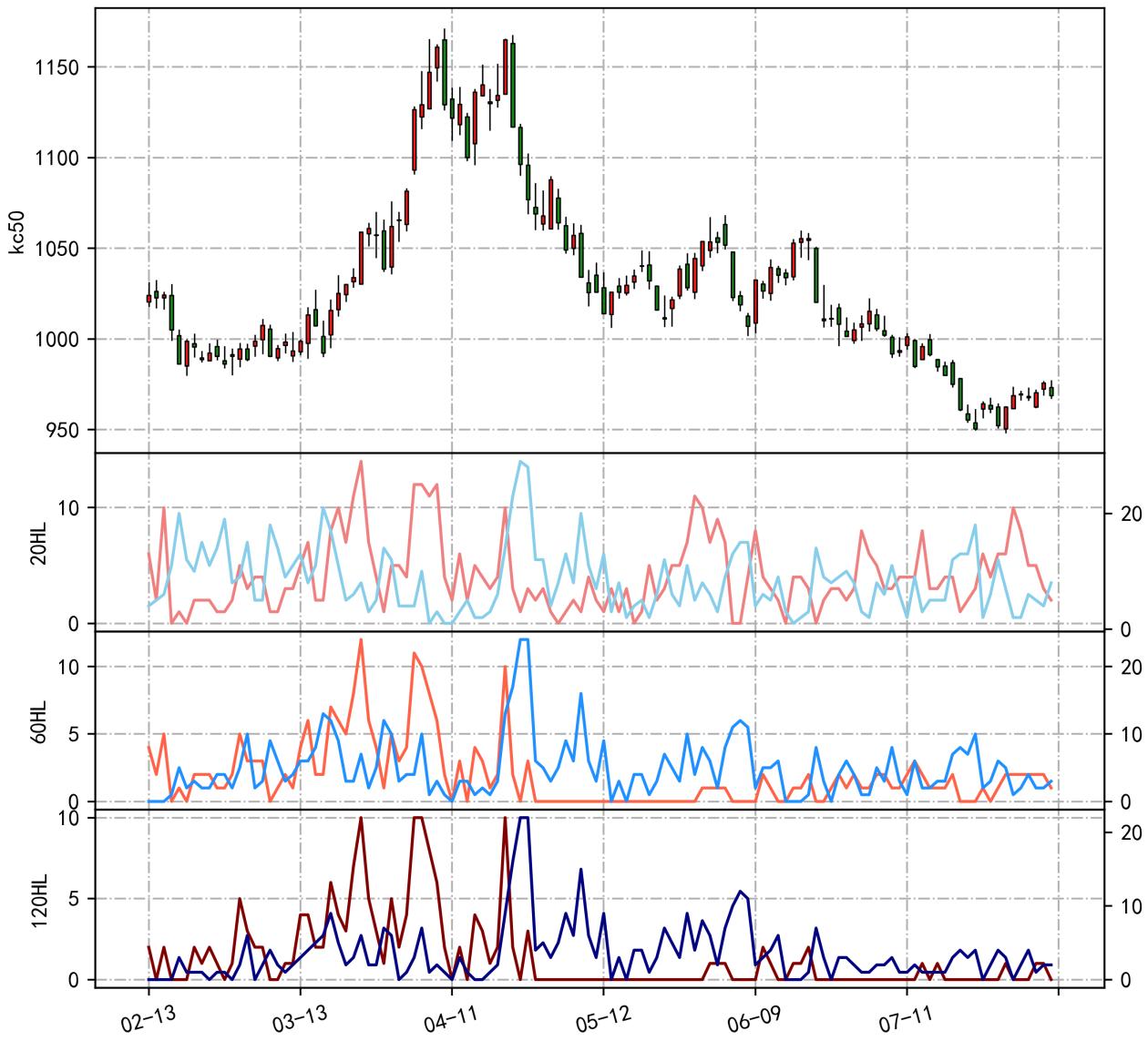


20-60-120日的新高新低数

- 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: 2 (**18.2, 14.3**); 1 (33.3, **8.3**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 8 (41.2, 25.0); 3 (25.0, **12.5**); 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: 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)

