

股指日报 (2023-08-04)

总括

恐慌指数 2023-08-03

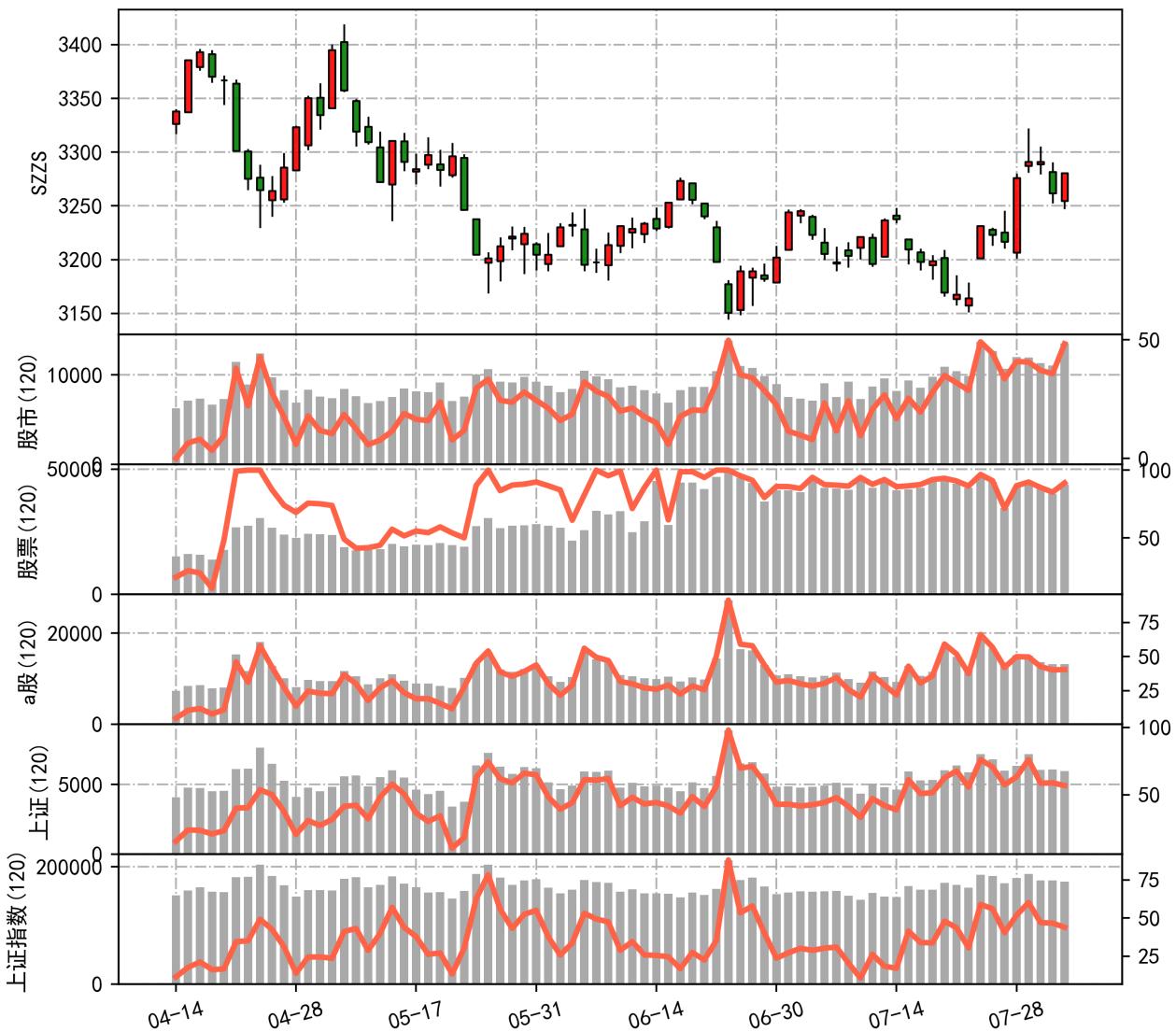
- 选用沪深**300ETF**期权波动率指数作为整个市场恐慌指数的表征
- 其后另附上证**50ETF**、中证**500ETF**等的期权波动率指数
- 计算分位数所用的周期长度 (20,60,120)
- 输出：指数-波动率指数-分位数

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 2023-08-03

- 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: 13506 (**96.6,48.3**)
 - 股票: 43817 (**88.3,90.6**)
 - a股: 13196 (41.3,40.5)
 - 上证: 5941 (58.1,56.8)
 - 上证指数: 174566 (50.8,43.9)



1. 牛市: 581 (45.4,45.4)

2. 熊市: 283 (46.6,38.2)



新高新低分位 2023-08-03

- 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: 586 (36.9,28.5); 322 (41.3,34.5); 140 (50.6,27.2);
- Low: 642 (27.3, **19.9**); 147 (**11.2,5.4**); 58 (**5.8,4.0**);



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: 1.21 (74.7,51.6,52.9)



主要指数分析 2023-08-03

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
- 股市: 13506 (**96.6**,48.3)
 - 上证50: 1794 (59.6,60.2)



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

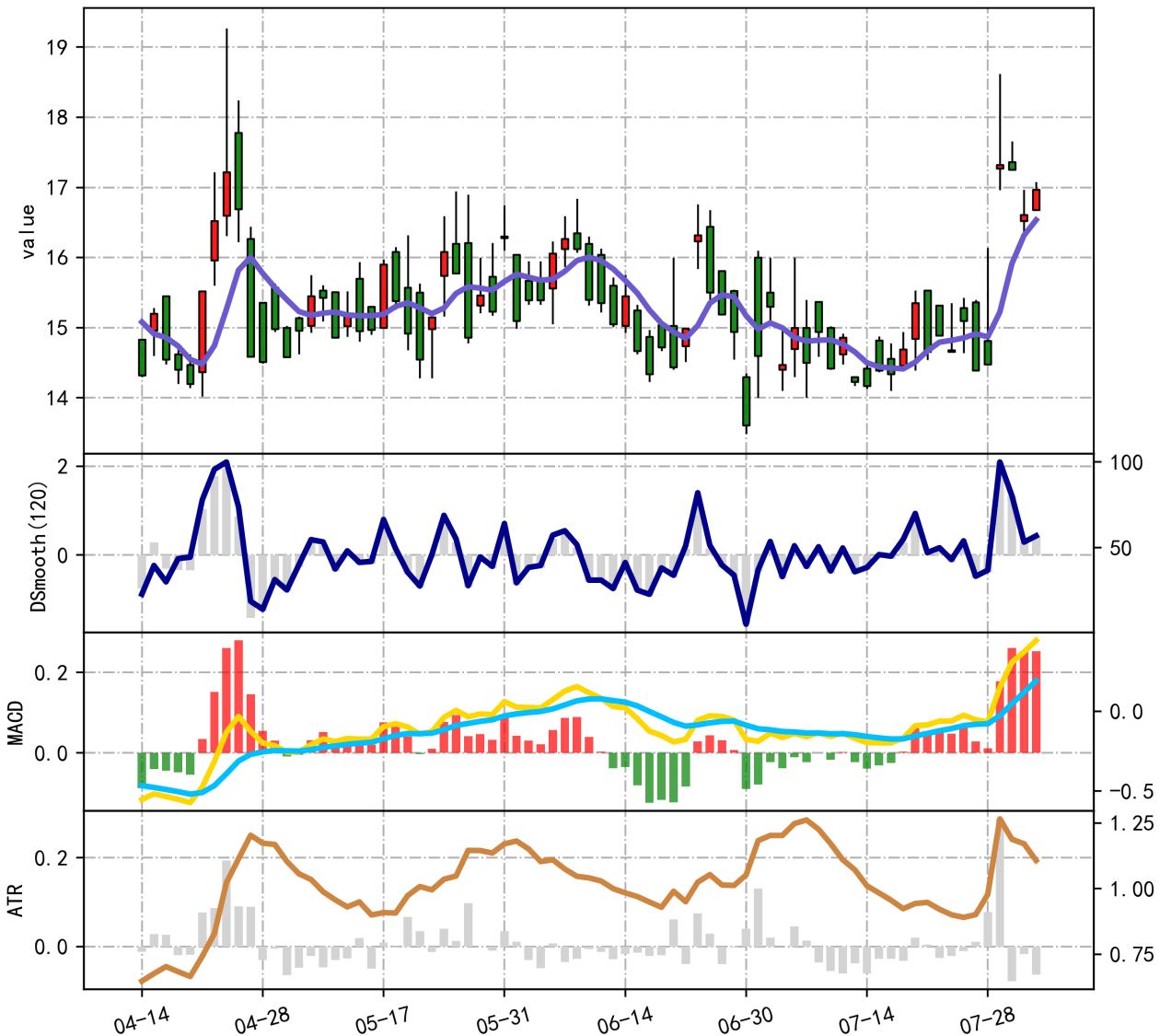
- High: 11 (52.4,52.4); 4 (44.4,33.3); 1 (25.0, **10.0**);
- Low: 3 (**10.7,10.7**); 1 (**5.0,5.0**); 0 (**0.0,0.0**);



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: 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: 13506 (**96.6,48.3**)
 - 沪深300: 4635 (62.3,62.3)

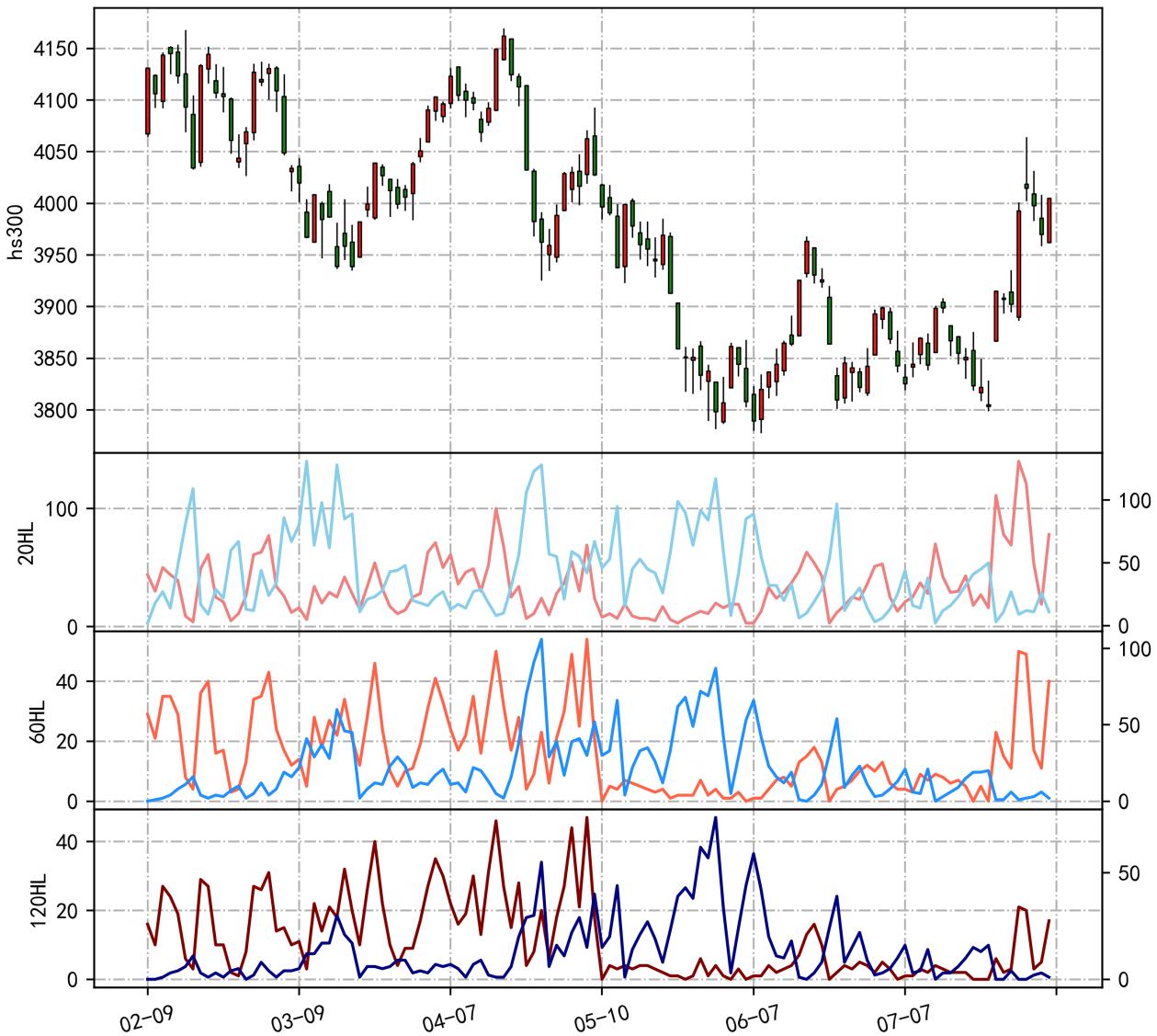


沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 78 (54.7,54.7); 40 (**80.0**,74.1); 17 (**81.0**,36.2);
- Low: 11 (**7.8,7.0**); 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: 13506 (**96.6**,48.3)
- 中证500: 3891 (67.9,46.6)



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: 101 (59.1,59.1); 66 (**87.8,86.7**); 33 (**100.0**,56.9);
- Low: 22 (**5.2,7.9**); 8 (**3.8,4.1**); 4 (**3.1,3.4**);



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: 13506 (**96.6**,48.3)
 2. 创业板指: 11147 (21.2,21.2)

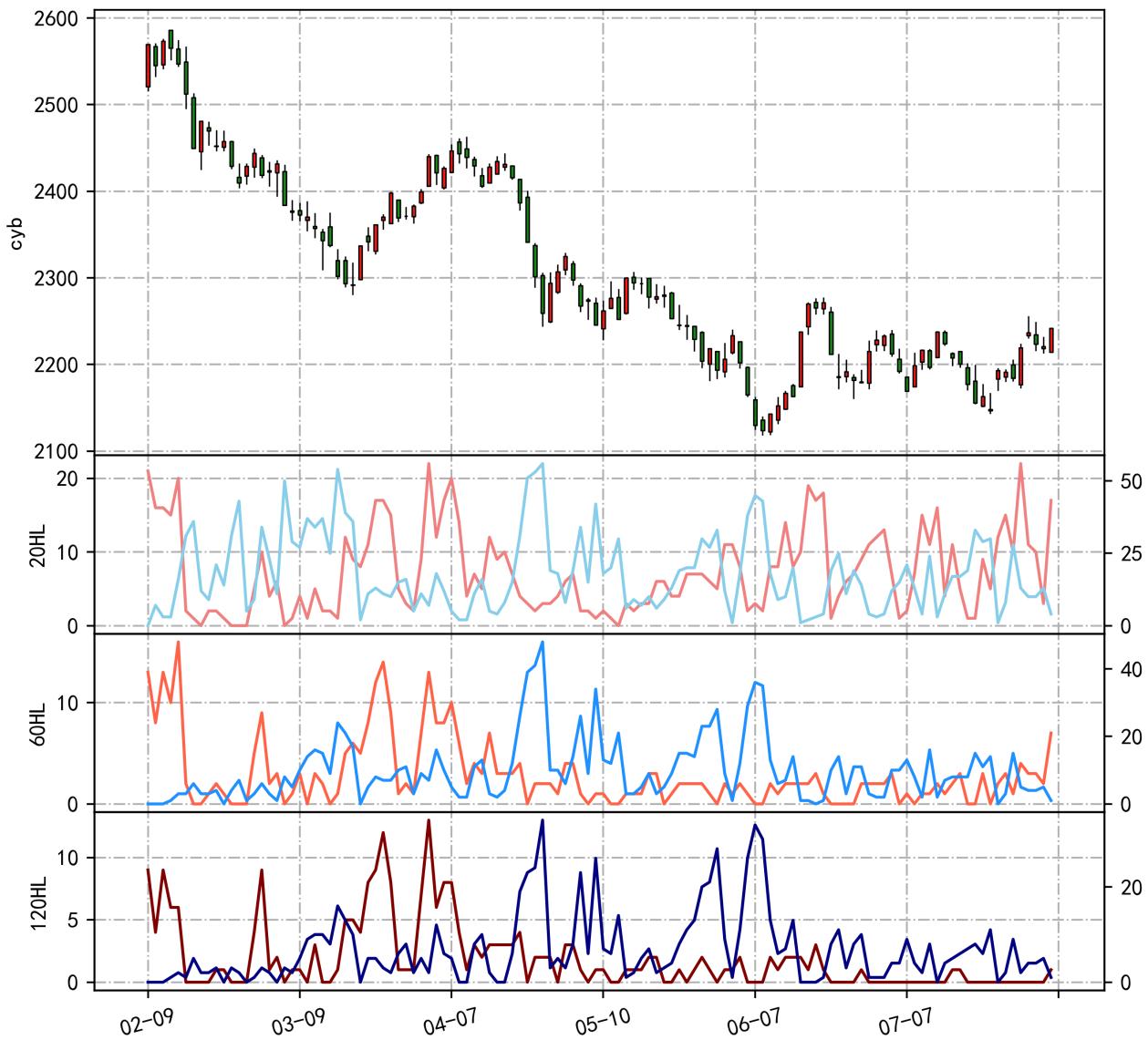


20-60-120日的新高新低数

- 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: 17 (77.3,77.3); 7 (**100.0**,43.8); 1 (33.3,**7.7**);
- Low: 4 (**6.8,7.1**); 1 (**2.8,2.1**); 1 (**3.0,2.9**);



科创板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: 13506 (**96.6**,48.3)
 2. 科创50: 2740 (68.3,69.2)

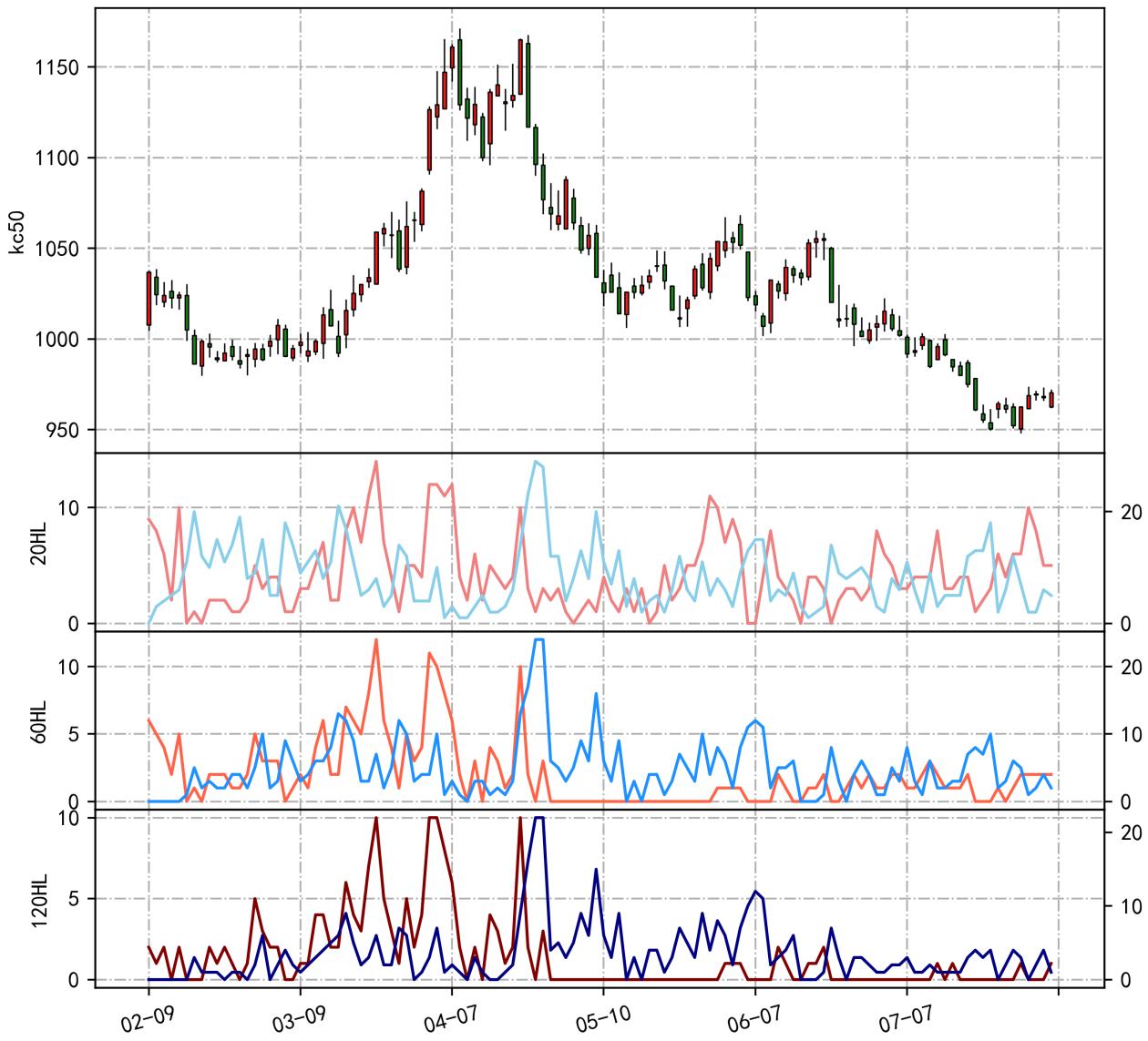


20-60-120日的新高新低数

- 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: 5 (45.5, 35.7); 2 (66.7, **16.7**); 1 (50.0, **10.0**);
- Low: 5 (23.5, **17.2**); 2 (**16.7**, **8.3**); 1 (**8.3**, **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

- 港股: 1553 (26.5,26.5)
- 恒生指数: 15463 (77.2,61.6)



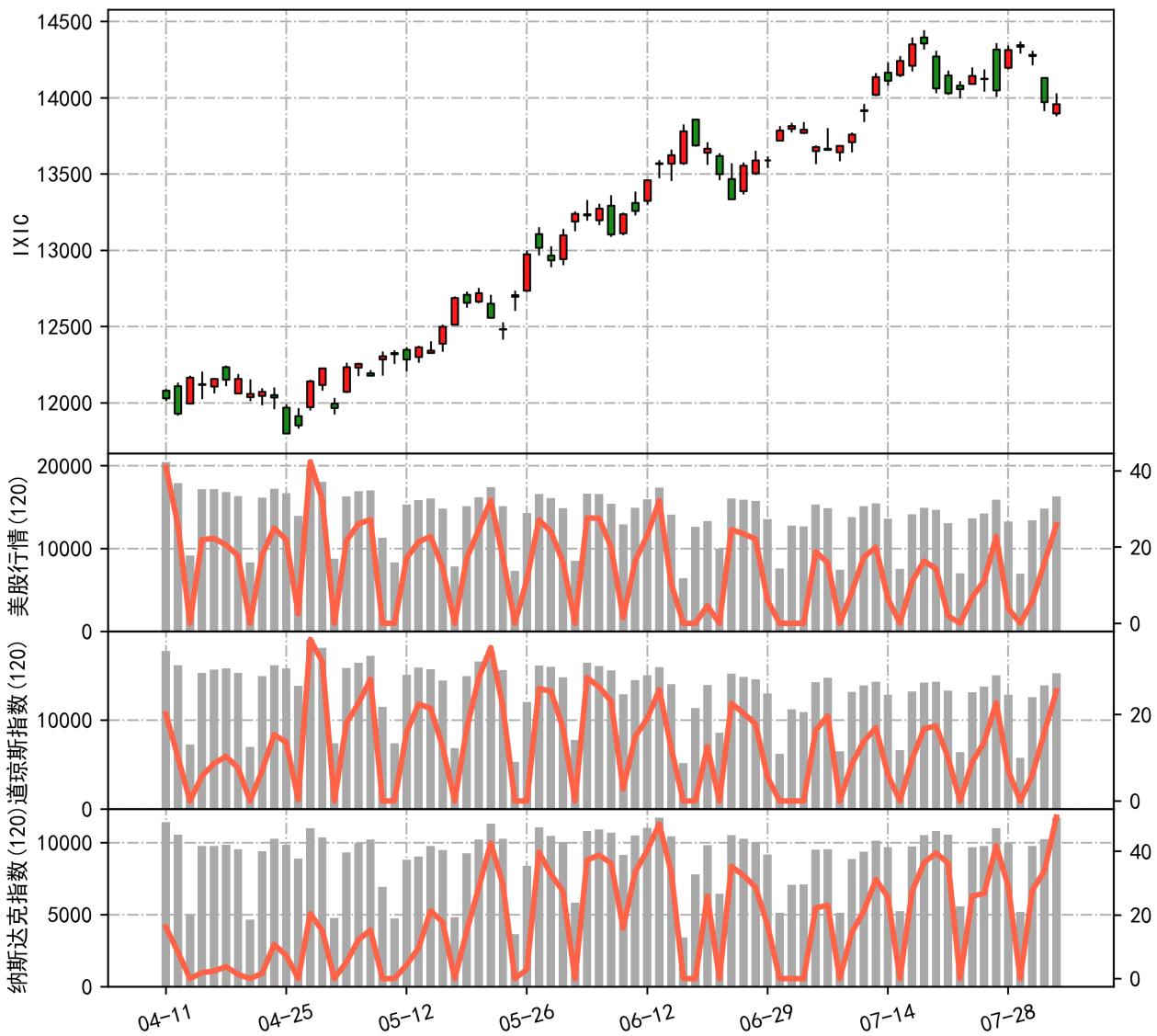
恒生科技指数: 12946 (71.4,74.2)



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: 16309 (**85.8**,25.8)
 2. 道琼斯指数: 15276 (72.6,25.4)
 3. 纳斯达克指数: 11733 (**99.9**,50.8)



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: 832 (40.2,33.6)

