

股指日报 (2023-08-01)

总括

恐慌指数 2023-07-31

- 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: 17.32 (**100.0,100.0,100.0**)
2. 50ETF: 18.36 (**100.0,100.0,100.0**)



检索量波动 2023-07-30

- 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: 11989 (79.6,40.8)
 - 股票: 42699 (**85.8,88.6**)
 - a股: 15123 (52.4,50.0)
 - 上证: 6329 (64.7,63.2)
 - 上证指数: 180808 (59.9,51.8)



1. 牛市: 1066 (**100.0,100.0**)

2. 熊市: 263 (31.7,26.0)



新高新低分位 2023-07-31

- 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: 1312 (**100.0,76.3**); 686 (**100.0,83.4**); 229 (72.3,53.7);
- Low: 401 (**15.0,11.9**); 100 (**6.7,3.6**); 48 (**4.6,3.2**);



北向资金流入 2023-08-01

- 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: 1.65 (**93.1**,47.3,59.3)



主要指数分析 2023-07-30

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: 17.32 (**100.0,100.0,100.0**)

2. 50ETF: 18.36 (**100.0,100.0,100.0**)



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: 11989 (79.6,40.8)
 - 上证50: 2214 (**97.1,96.7**)

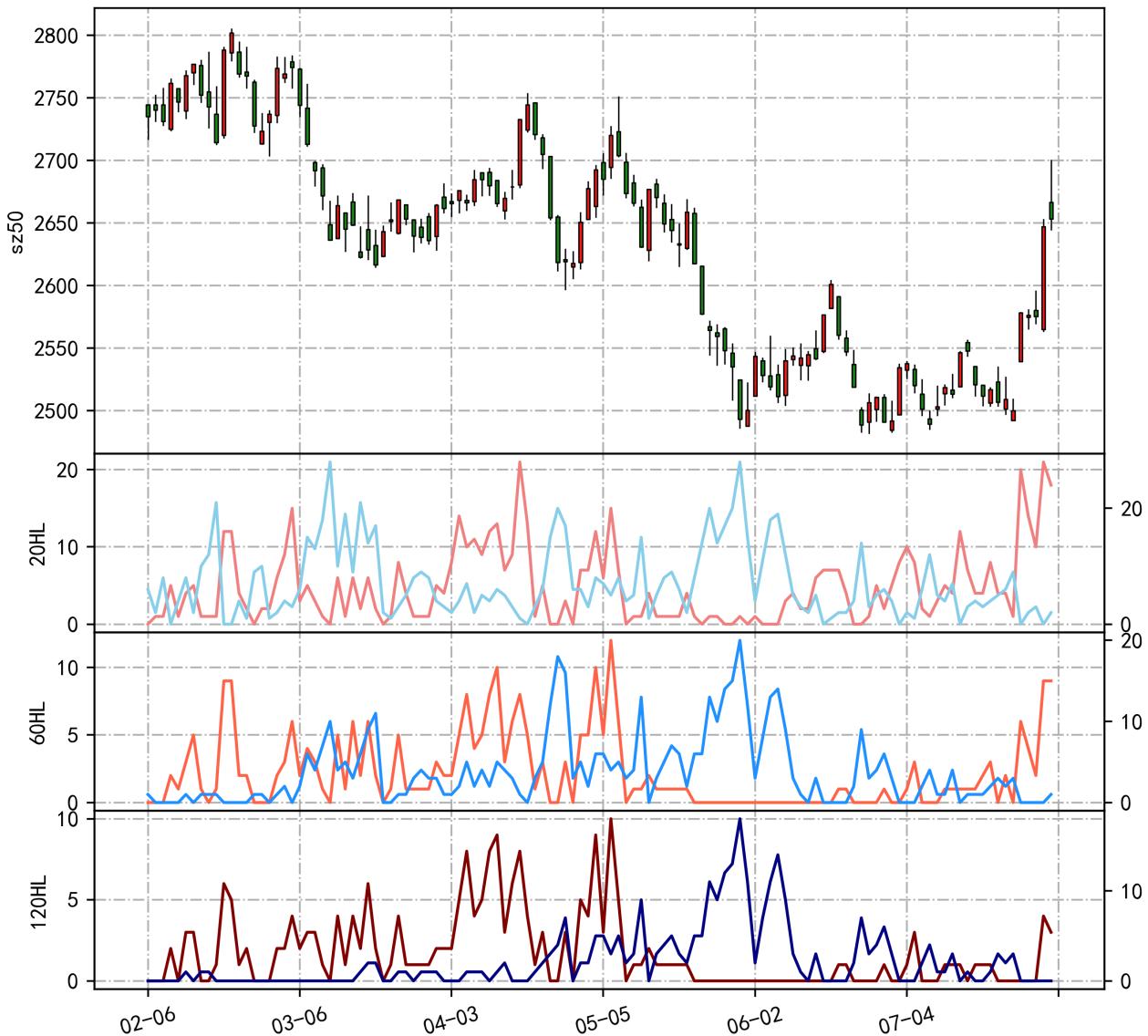


20-60-120日的新高新低数

- 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: 18 (**85.7,85.7**); 9 (75.0,75.0); 3 (30.0,30.0);
- Low: 2 (**7.1,7.1**); 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: 17.32 (**100.0,100.0,100.0**)
 2. 50ETF: 18.36 (**100.0,100.0,100.0**)



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: 11989 (79.6,40.8)
 - 沪深300: 5034 (**100.0,92.9**)



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: 121 (**86.1,86.1**); 49 (**90.7,90.7**); 20 (42.6,42.6);
- Low: 12 (**8.7,7.8**); 2 (**2.3,1.9**); 0 (**0.0,0.0**);



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

1. 股市: 11989 (79.6,40.8)

2. 中证500: 3972 (**84.1**,50.0)

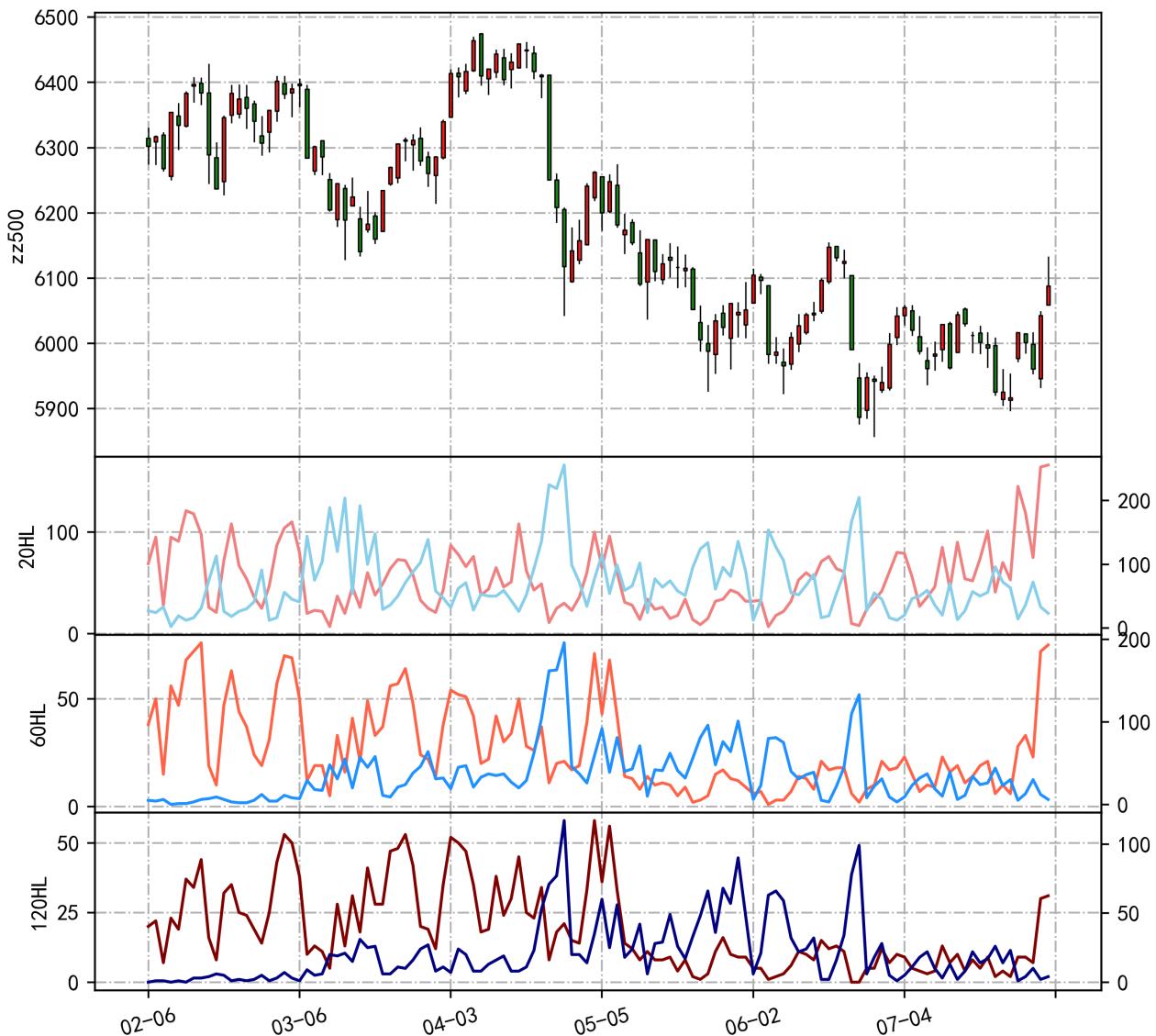


20-60-120日的新高新低数

- 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. zz500

- High: 166 (**100.0,100.0**); 75 (**100.0,98.7**); 31 (55.4,53.4);
- Low: 23 (**5.7,8.3**); 6 (**2.3,3.1**); 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

- 股市: 11989 (79.6,40.8)
- 创业板指: 11942 (37.3,37.3)

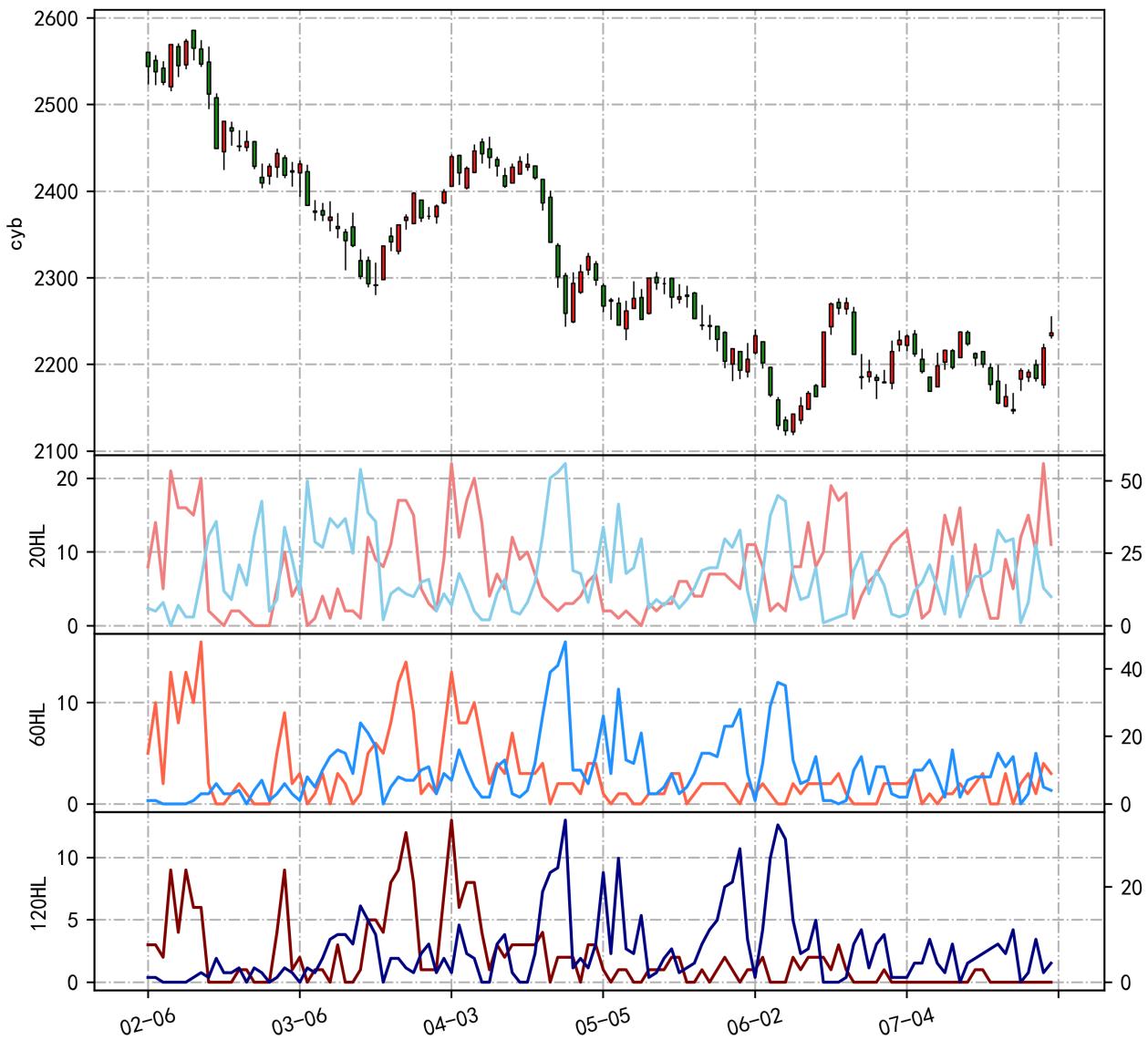


20-60-120日的新高新低数

- 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: 11 (50.0,50.0); 3 (75.0, **18.8**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 10 (20.5, **17.9**); 4 (**11.1,8.3**); 4 (**12.1,11.8**);



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
1. 股市: 11989 (79.6,40.8)
 2. 科创50: 3089 (**100.0,83.2**)

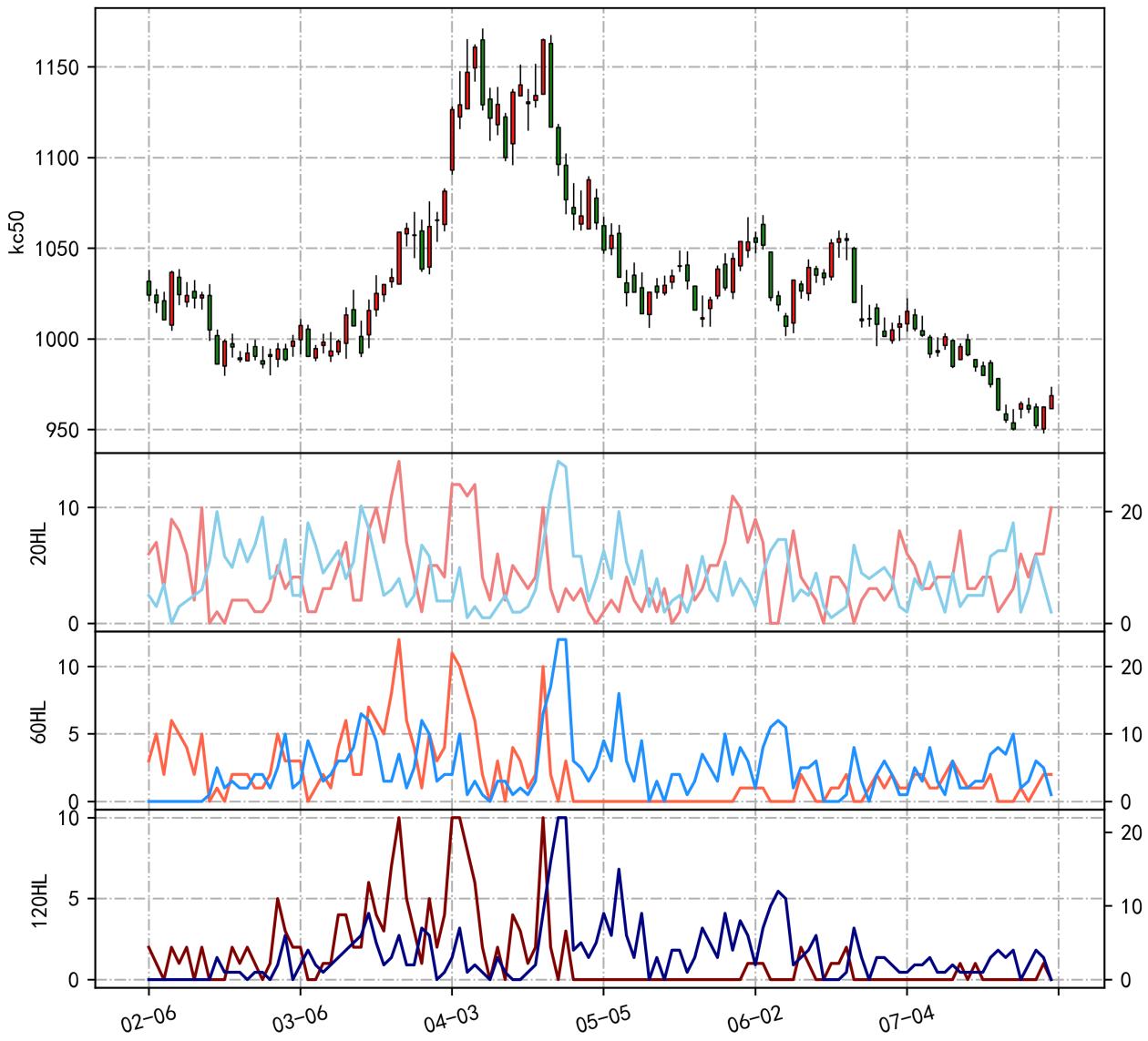


20-60-120日的新高新低数

- 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: 10 (**90.9,71.4**); 2 (**66.7,16.7**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 2 (**5.3,6.9**); 1 (**6.2,4.2**); 0 (**0.0,0.0**);



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: 1654 (31.9,31.9)
2. 恒生指数: 14110 (64.1,52.1)



恒生科技指数: 15401 (100.0, 100.0)



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: 13287 (31.9, **3.9**)
 2. 道琼斯指数: 12878 (34.0, **7.0**)
 3. 纳斯达克指数: 9942 (66.6, 29.1)



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: 771 (23.1,25.1)

