

股指日报 (2023-07-13)

总括

恐慌指数 2023-07-13

- 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
- 300ETF: 14.23 (39.9,32.3,35.9)
 - 50ETF: 14.87 (38.5,33.4,41.1)

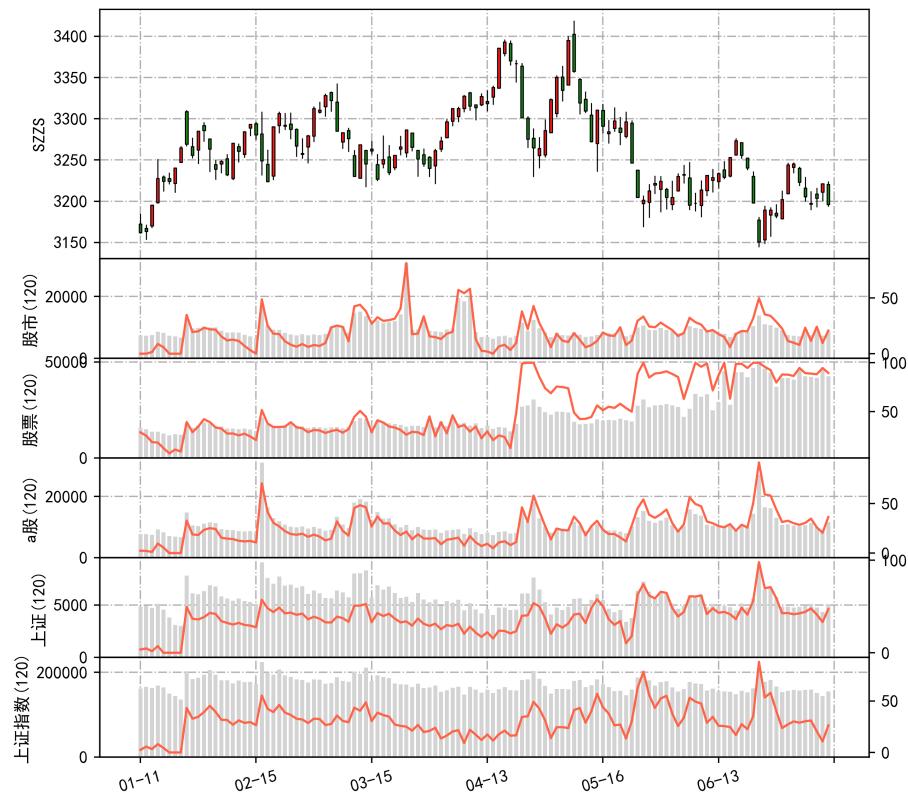


检索量波动 2023-07-12

- 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

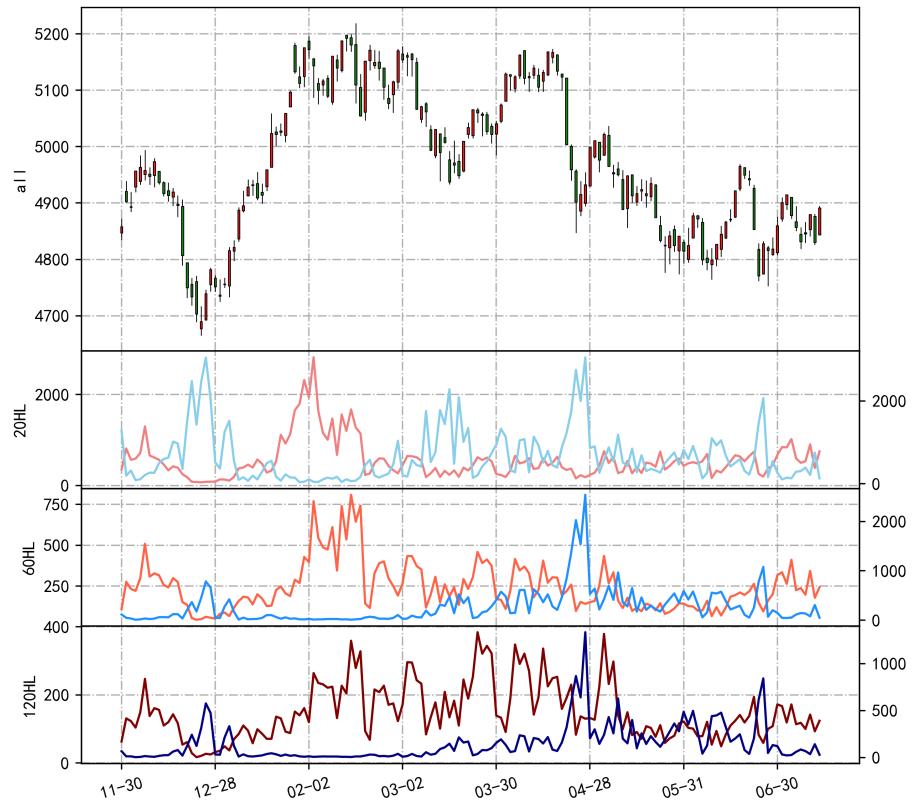
- 股市: 8706 (41.6,20.7)

2. 股票: 42534 (**88.3,89.5**)
3. a 股: 11606 (34.8,36.4)
4. 上证: 5069 (41.5,47.2)
5. 上证指数: 155064 (20.1,26.2)



新高新低分位 2023-07-13

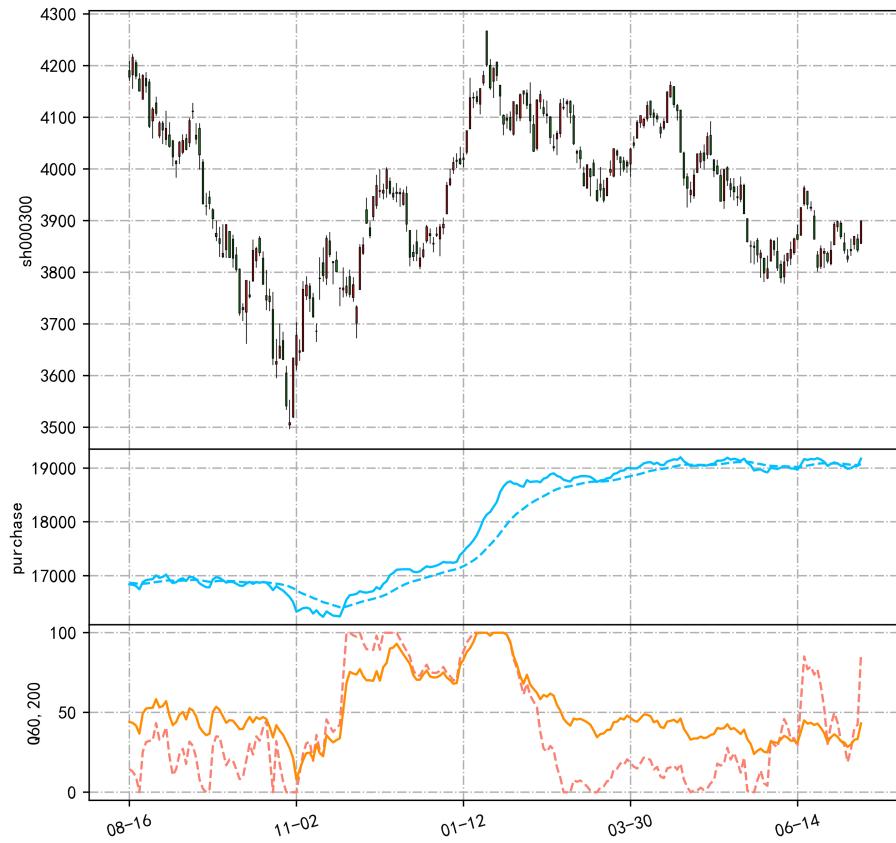
- 20-60-120 日的新高新低数, 再对该数量使用周期长度 (60,120) 求取分位数
 - 输出: 指数-某一周期新高数 (分位数)-某一周期新低数 (分位数)
1. all
 - High: 748 (68.6,22.3); 242 (47.8,23.7); 124 (22.7,22.4);
 - Low: 131 (**0.8,3.1**); 48 (**0.2,1.5**); 29 (**0.5,1.8**);



北向资金流入 2023-07-13

- 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: 0.55 (**86.1**,25.2,43.1)



主要指数分析

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: 14.23 (39.9,32.3,35.9)
 2. 50ETF: 14.87 (38.5,33.4,41.1)



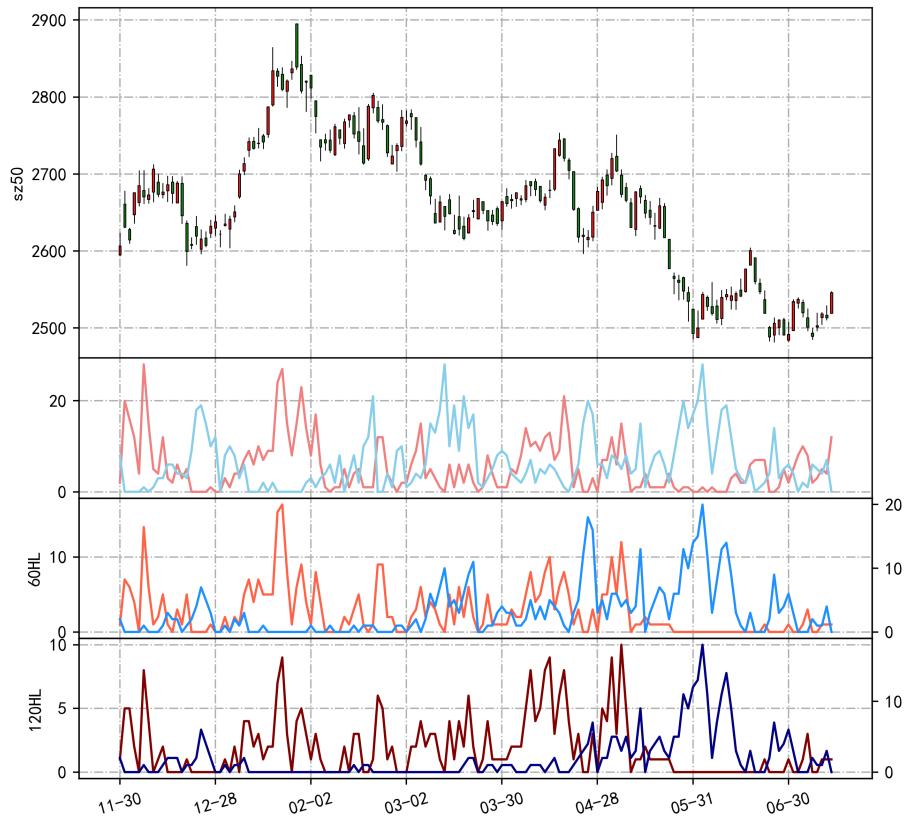
- 上证 50 搜索指数
 - 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出：检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8706 (41.6,20.7)
 2. 上证 50: 1468 (25.5,26.0)



- 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. sz50

- High: 12 (57.1,44.4); 1 (**8.3,5.9**); 1 (**10.0,10.0**);
- Low: 0 (**0.0,0.0**); 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: 14.23 (39.9,32.3,35.9)
 2. 50ETF: 14.87 (38.5,33.4,41.1)



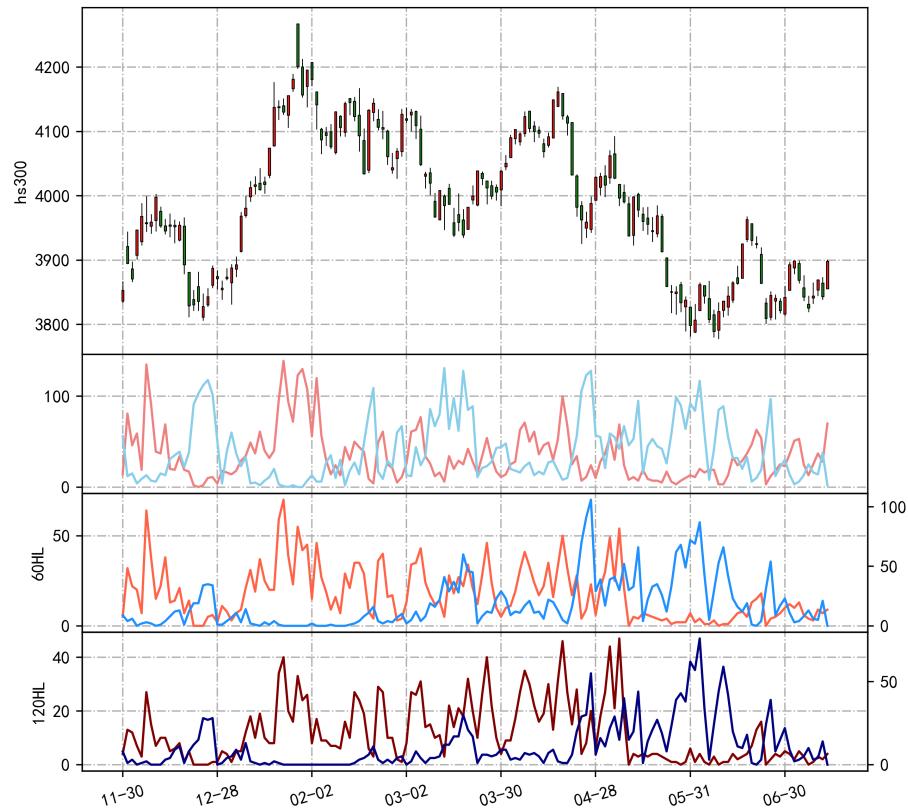
- 沪深 300 搜索指数
 - 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出：检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8706 (41.6,20.7)
 2. 上证 50: 1468 (25.5,26.0)



- 沪深 300 成分股 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. hs300

- High: 70 (69.1,49.3); 9 (**16.7,12.9**); 4 (**8.5,8.5**);
- Low: 2 (**0.0,1.5**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);



中证 500

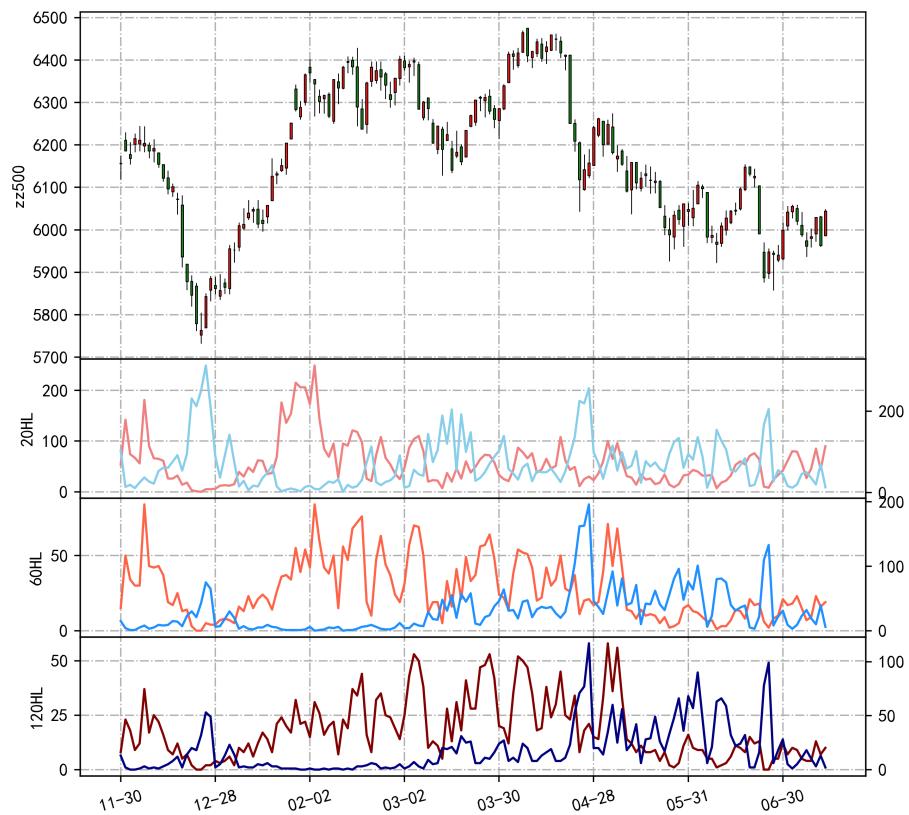
- 中证 500 搜索指数
 - 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出: 检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8706 (41.6,20.7)
 2. 中证 500: 3410 (30.9,23.8)



- 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: 90 (**82.2,34.3**); 19 (25.7,21.7); 10 (**17.2,17.2**);
- Low: 13 (**0.4,4.3**); 6 (**1.6,3.1**); 2 (**0.9,1.7**);



创业板指

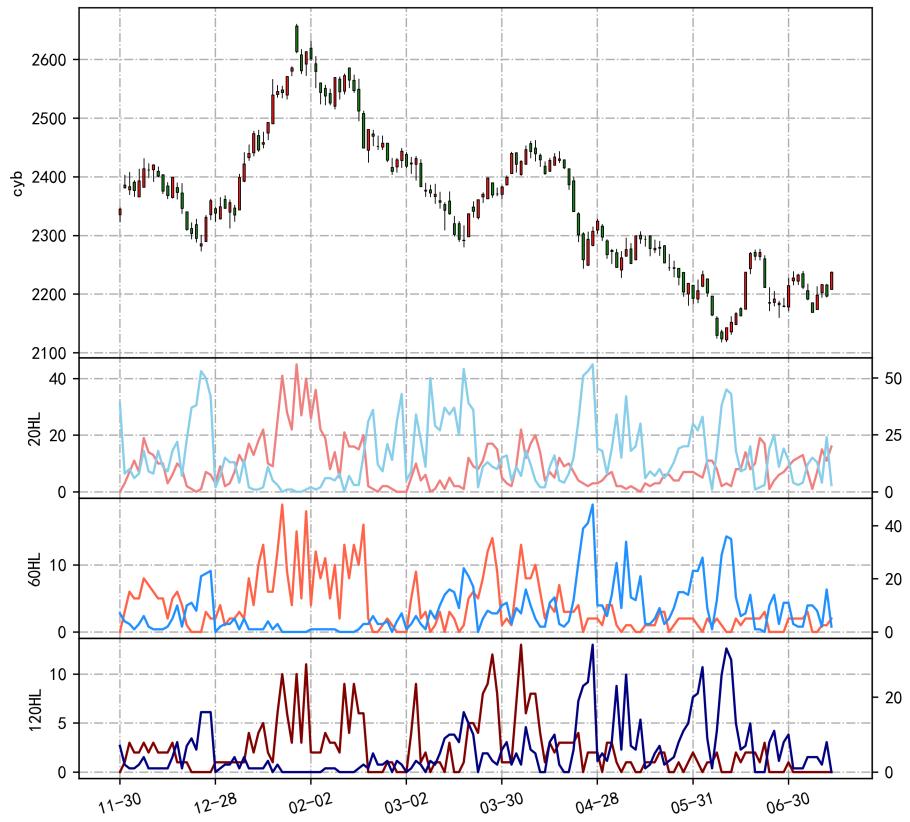
- 创业板搜索指数
 - 计算分位数所用的周期长度 (60,120)
 - 输出: 检索词-检索量-分位数
1. 股市: 8706 (41.6,20.7)
 2. 创业板指: 11142 (21.0,24.0)



- 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: 16 (**84.2**,35.6); 2 (28.6,**10.5**); 0 (**0.0**,**0.0**);
- Low: 3 (**3.6**,5.4); 2 (**4.2**,**4.2**); 0 (**0.0**,**0.0**);



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: 8706 (41.6,20.7)
 2. 科创 50: 2650 (62.8,69.4)



- 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. kc50

- High: 8 (72.7,34.8); 2 (**20.0,16.7**); 1 (**10.0,10.0**);
- Low: 3 (**7.1,10.3**); 2 (**8.3,8.3**); 1 (**4.5,4.5**);



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
1. 港股: 1555 (37.9,30.5)
 2. 恒生指数: 15538 (71.9,62.1)



恒生科技指数: 11341 (**97.4,97.4**)



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: 15107 (47.6,**17.4**)
 2. 道琼斯指数: 13901 (44.0,**13.8**)
 3. 纳斯达克指数: 9367 (54.8,21.2)

