

# 股指日报 (2023-07-28)

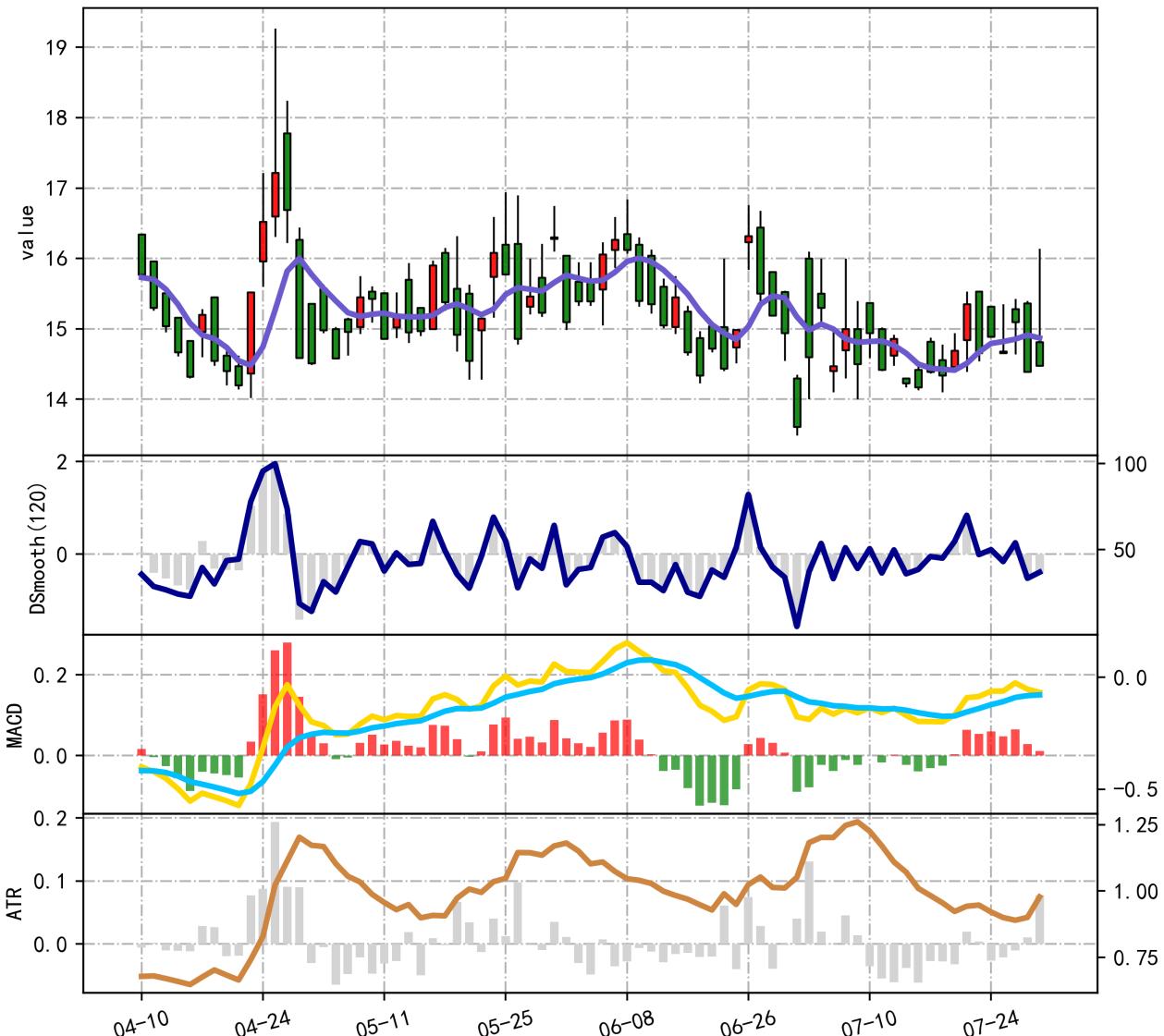
---

## 总括

### 恐慌指数 2023-07-28

- 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: 14.48 (**10.1**,41.1,36.8)
2. 50ETF: 15.20 (43.4,34.0,38.4)



## 检索量波动 2023-07-28

- 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: 11989 (79.6,40.8)
  2. 股票: 42699 (**85.8,88.6**)
  3. a股: 15123 (52.4,50.0)
  4. 上证: 6329 (64.7,63.2)
  5. 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)



## 新高新低分位数 2023-07-28

- 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: 1106 (**99.8**,62.8); 489 (**100.0**,56.9); 154 (31.8,31.3);
- Low: 562 (23.2,**17.2**); 150 (**11.5**,**5.6**); 53 (**5.2**,**3.6**);



## 北向资金流入 2023-07-28

- 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: 1.53 (**100.0**,44.2,57.6)



## 主要指数分析 2023-07-28

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: 14.48 (**10.1**,41.1,36.8)

2. 50ETF: 15.20 (43.4,34.0,38.4)



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

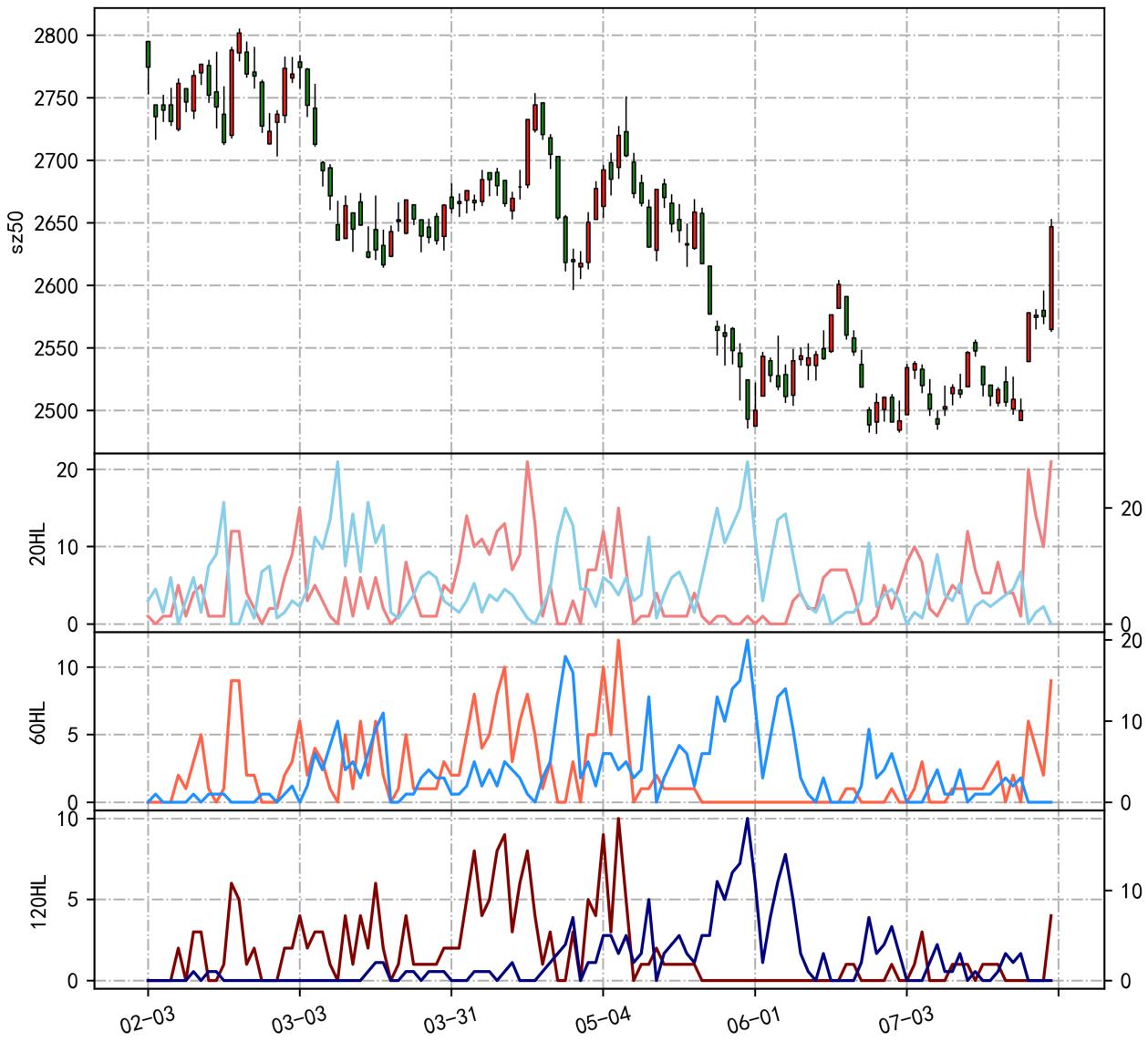


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 21 (**100.0,100.0**); 9 (75.0,75.0); 4 (40.0,40.0);
- 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: 14.48 (**10.1**,41.1,36.8)
  2. 50ETF: 15.20 (43.4,34.0,38.4)



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

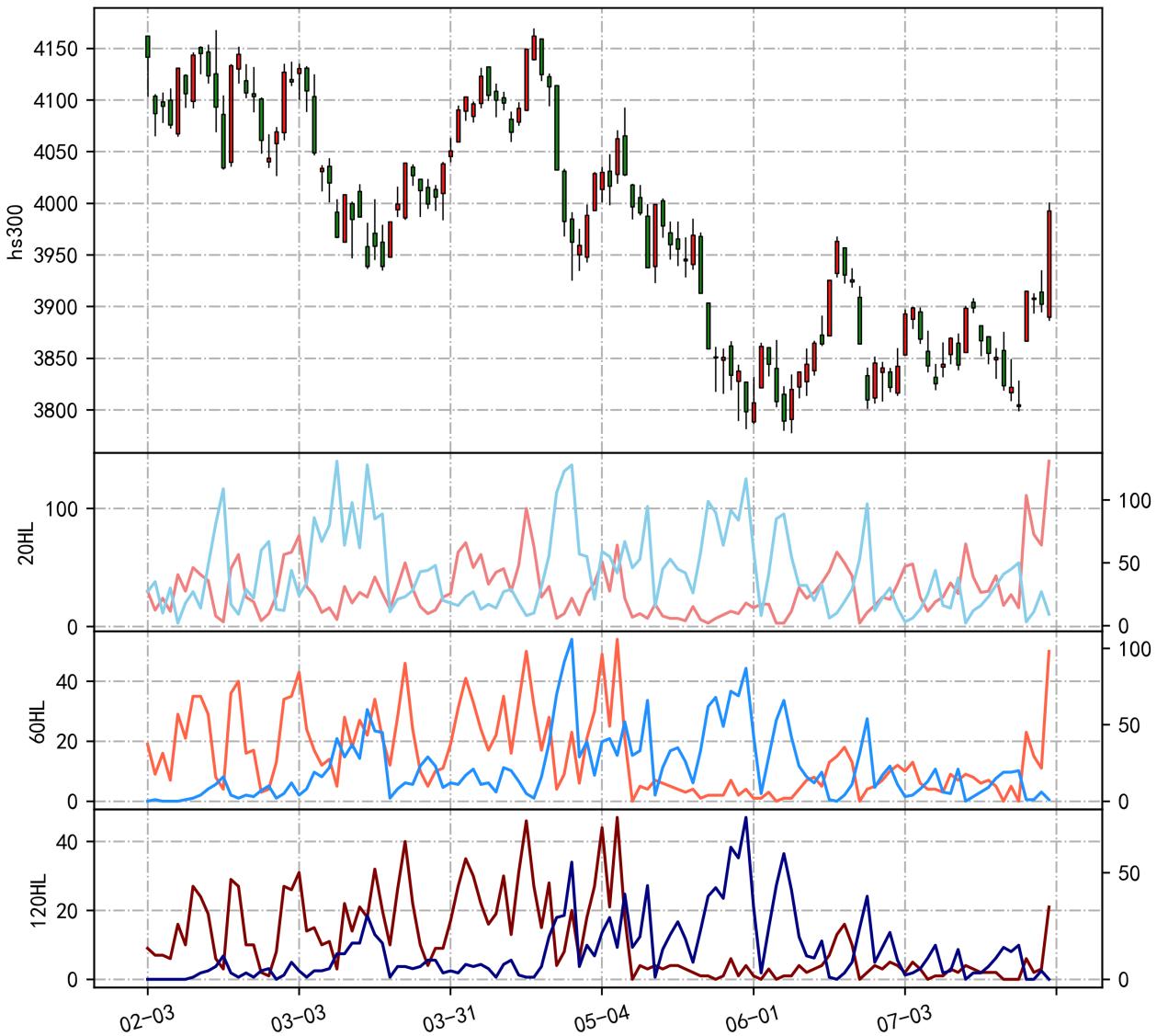


### 沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 140 (**100.0,100.0**); 50 (**92.6,92.6**); 21 (44.7,44.7);
- Low: 9 (**6.1,5.4**); 1 (**1.1,0.9**); 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

- 股市: 11989 (79.6,40.8)
- 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: 164 (**100.0,100.0**); 72 (**100.0,94.7**); 30 (51.7,51.7);
- Low: 33 (**10.9,12.2**); 12 (**6.9,6.1**); 2 (**1.0,1.7**);



## 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

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

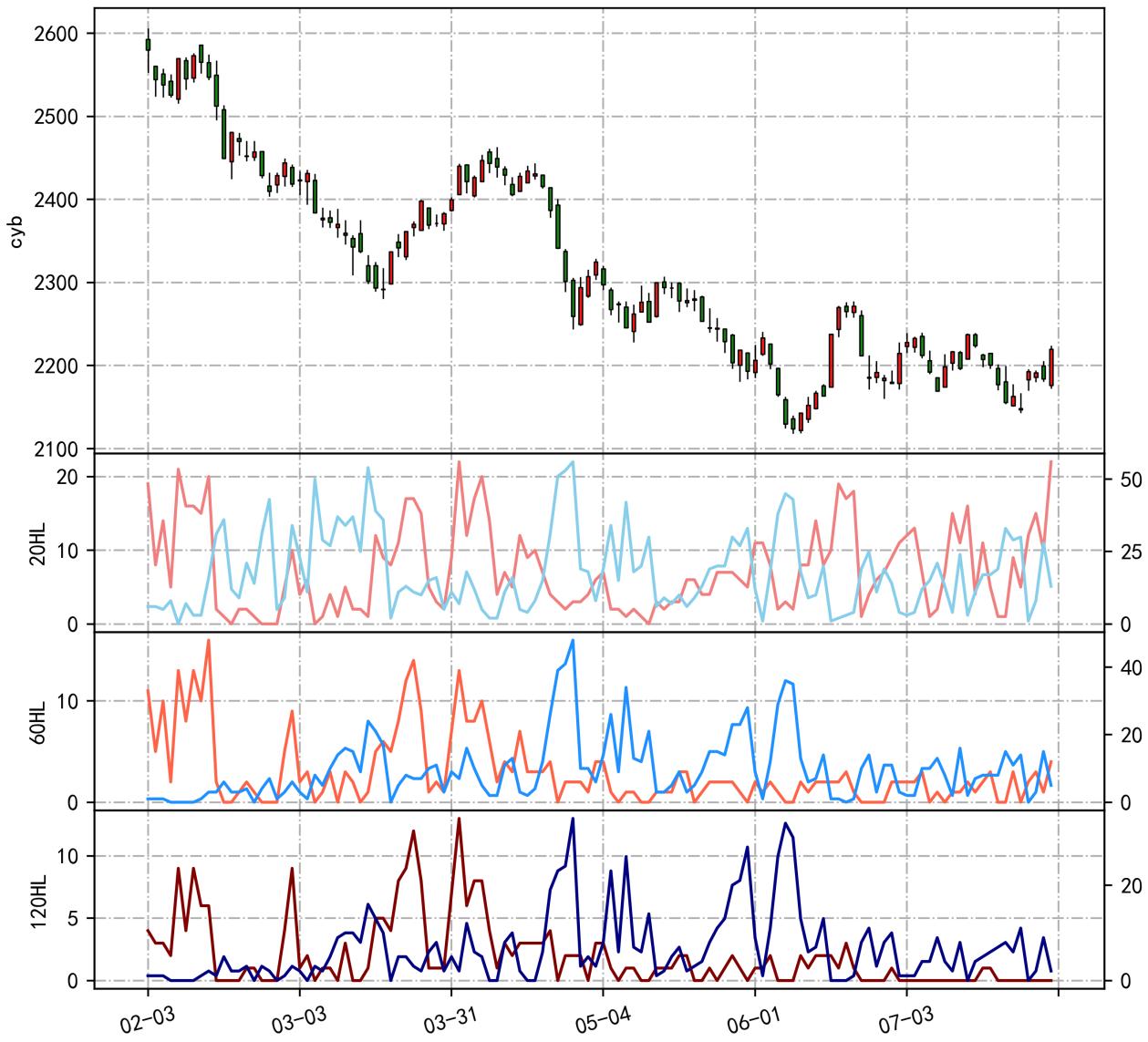


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 22 (**100.0,100.0**); 4 (**100.0**,25.0); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 13 (27.3,23.2); 5 (**13.9,10.4**); 2 (**6.1,5.9**);



## 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**)

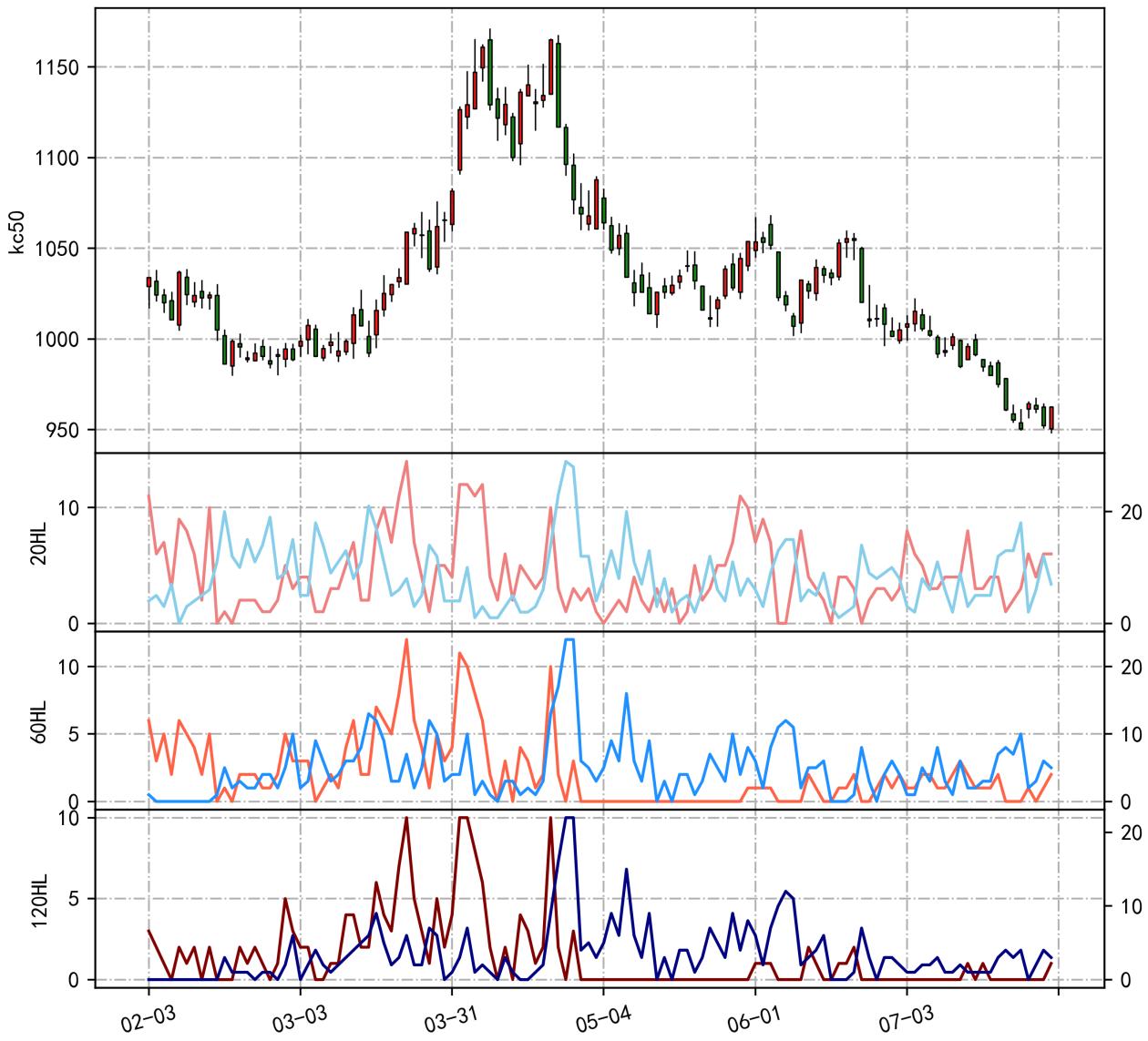


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 6 (54.5, 42.9); 2 (66.7, **16.7**); 1 (50.0, **10.0**);
- Low: 7 (31.6, 24.1); 5 (31.2, 20.8); 3 (**20.0**, **13.6**);



## 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)

