

# 股指日报 (2023-07-25)

## 总括

### 恐慌指数 2023-07-24

- 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: 14.89 (69.1,47.2,50.0)

2. 50ETF: 14.84 (36.1,29.1,34.8)



## 检索量波动 2023-07-23

- 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: 10390 (59.2,31.8)
  2. 股票: 44174 (**89.1,92.0**)
  3. a股: 14768 (50.5,52.0)
  4. 上证: 6360 (65.2,67.8)
  5. 上证指数: 169180 (42.7,43.7)



1. 牛市: 399 (**16.1, 16.1**)

2. 熊市: 268 (35.5, 31.2)



## 新高新低分位 2023-07-24

- 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: 481 (37.2, **12.3**); 157 (24.7, **12.2**); 53 (**1.2,1.2**);
- Low: 761 (22.2,23.8); 208 (**6.6,7.9**); 153 (**10.0,11.1**);



## 北向资金流入 2023-07-25

- 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: -0.12 (43.5, **12.1**, 33.1)



## 主要指数分析 2023-07-23

包括内地宽基指数、港股指数等

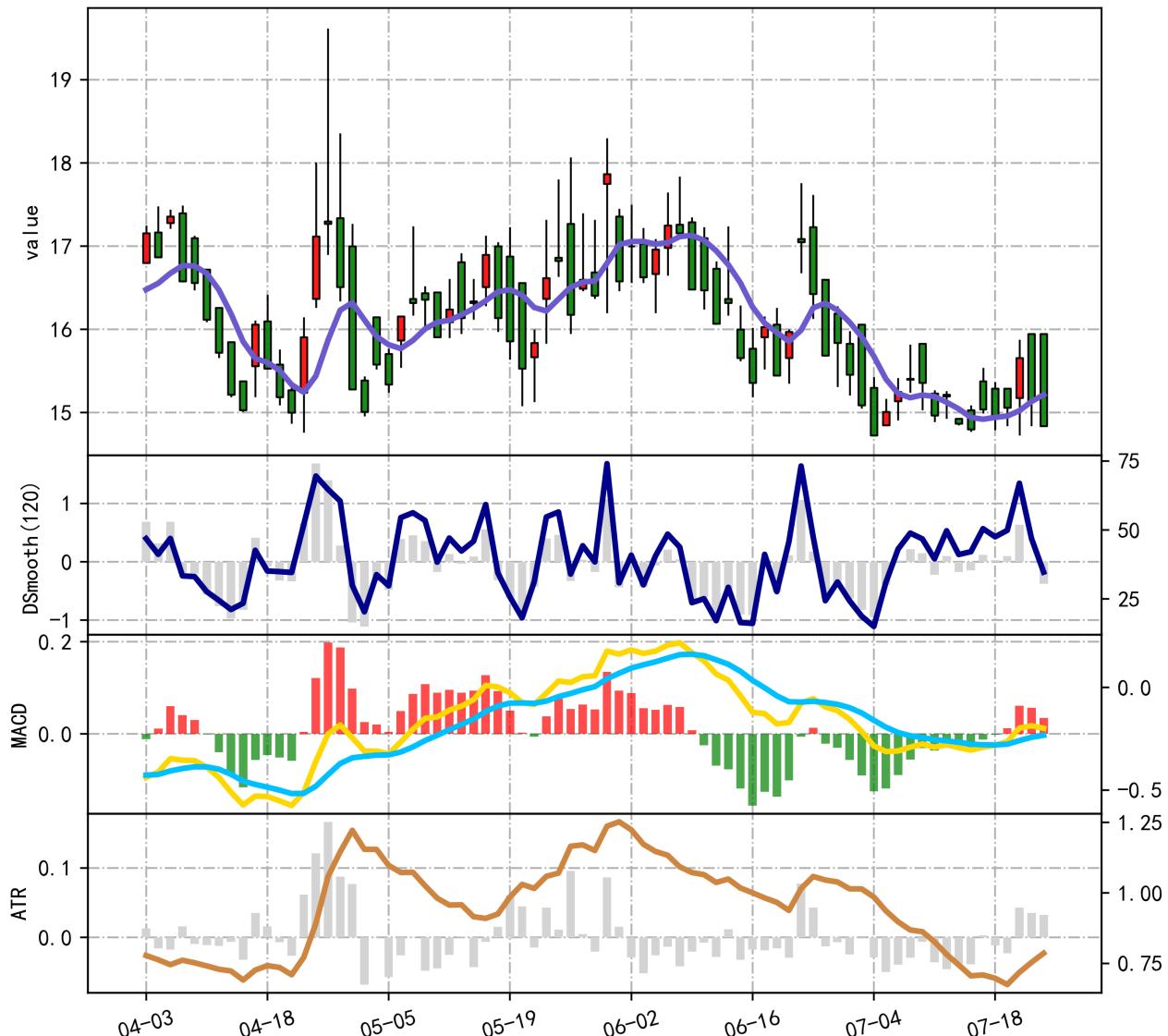
### 上证50

#### 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: 14.89 (69.1,47.2,50.0)

2. 50ETF: 14.84 (36.1,29.1,34.8)



## 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: 10390 (59.2,31.8)
  2. 上证50: 1480 (27.0,27.4)

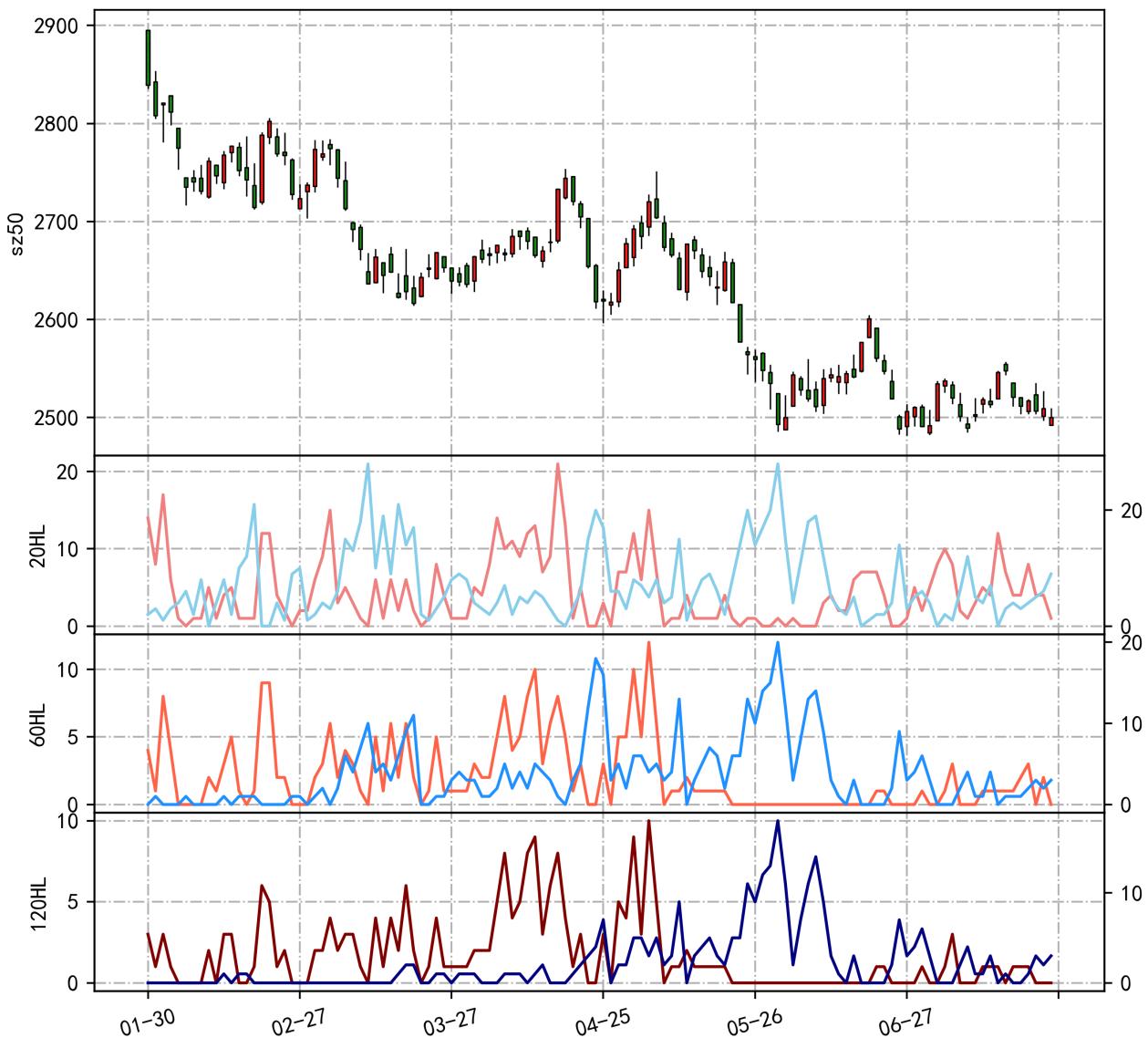


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 1 (**6.7, 4.8**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 9 (32.1, 32.1); 3 (**15.0, 15.0**); 3 (**16.7, 16.7**);



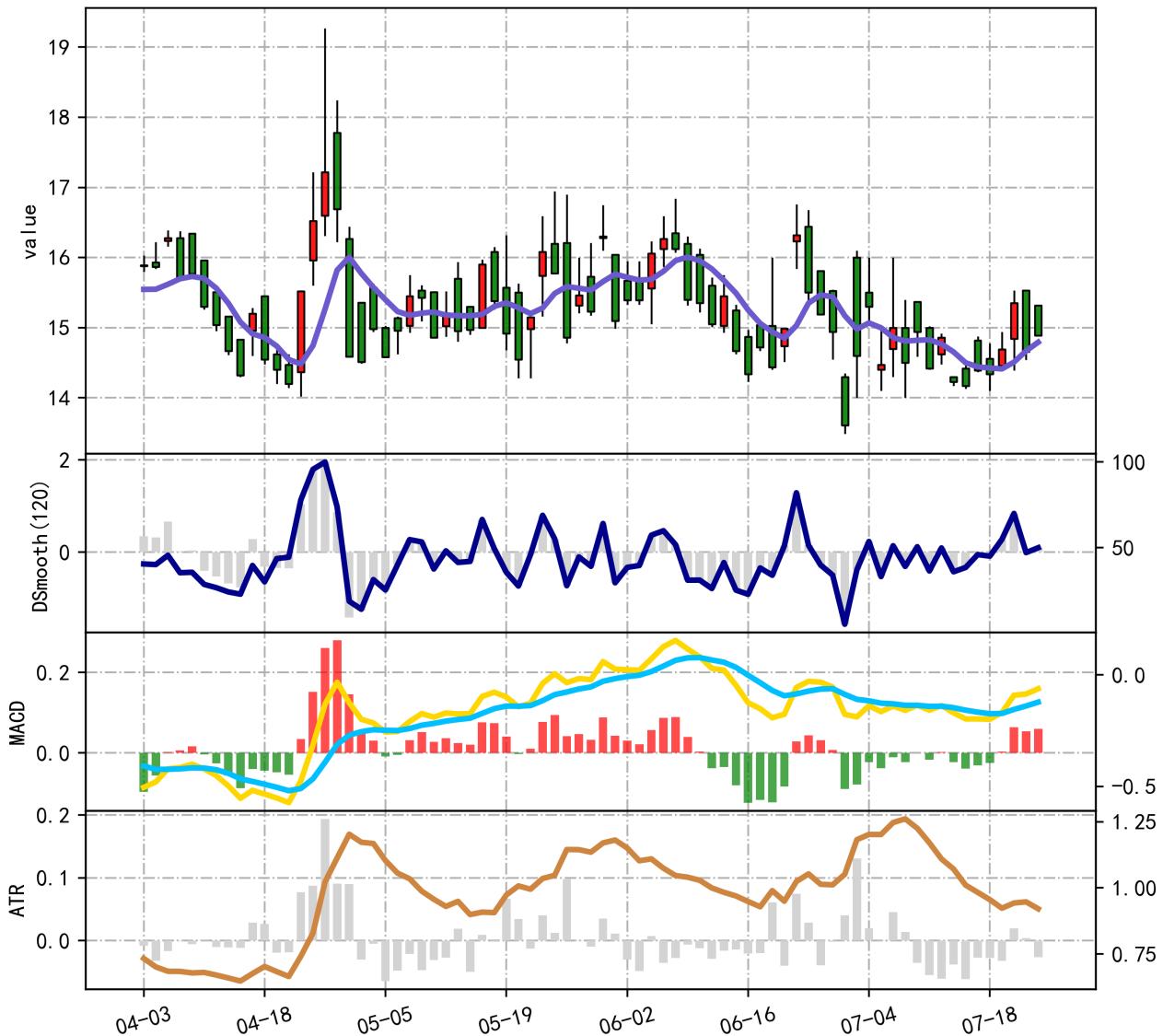
## 沪深300

### 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: 14.89 (69.1,47.2,50.0)

2. 50ETF: 14.84 (36.1,29.1,34.8)



## 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: 10390 (59.2,31.8)
  - 沪深300: 3863 (40.3,32.4)

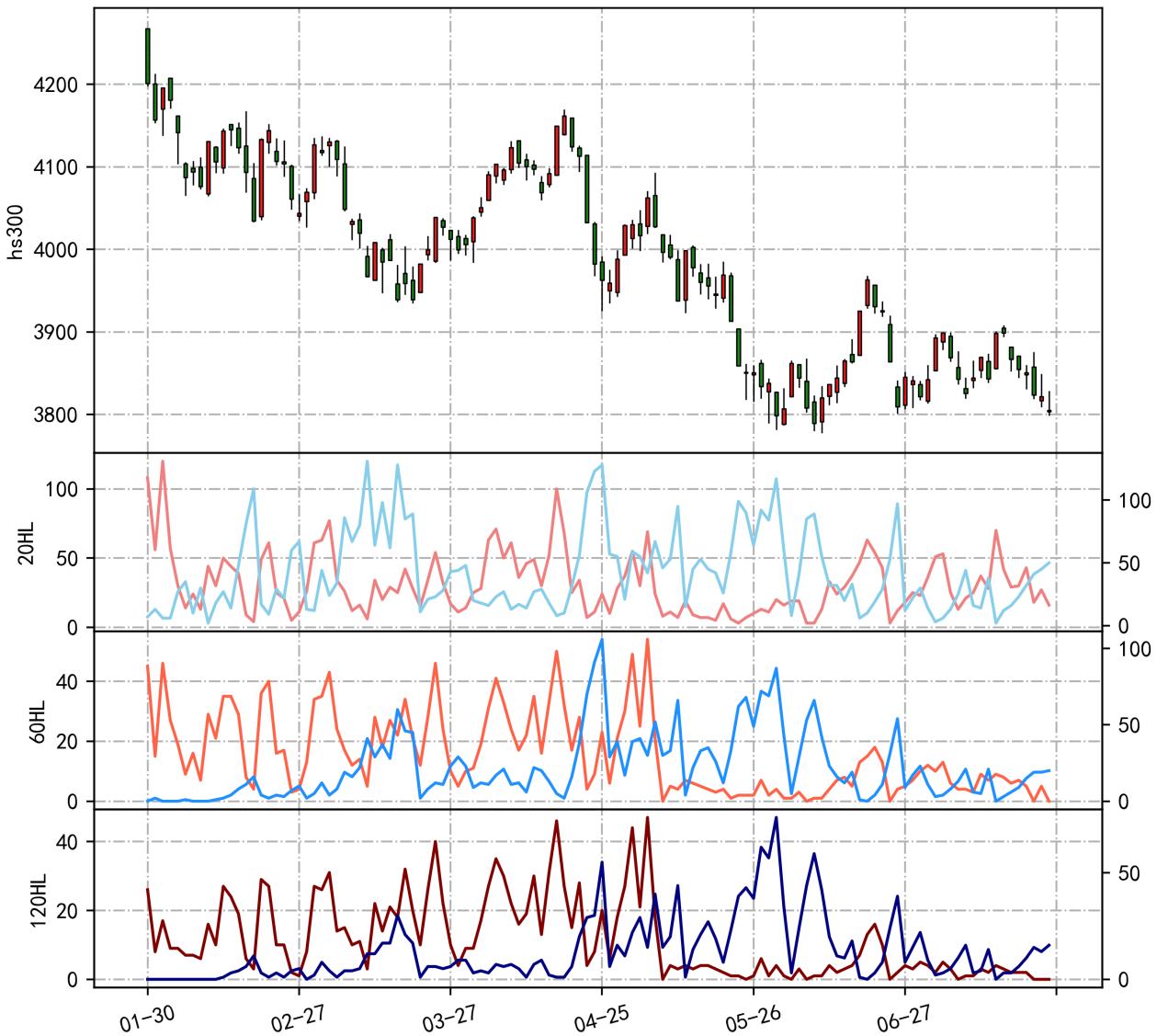


### 沪深300成分股20-60-120日的新高新低数

- 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: 16 (**19.4, 11.1**); 0 (**0.0, 0.0**); 0 (**0.0, 0.0**);
- Low: 50 (38.1, 37.2); 20 (**18.9, 18.9**); 16 (21.1, 21.1);



## 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: 10390 (59.2,31.8)

2. 中证500: 3199 (**17.3,13.3**)



## 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. zz500

- High: 53 (48.9, **19.0**); 6 (**7.1,6.0**); 2 (**3.4,3.4**);
- Low: 63 (20.9,24.0); 30 (**14.0,15.3**); 23 (**19.0,19.7**);



## 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: 10390 (59.2,31.8)
- 创业板指: 11447 (27.4,30.1)

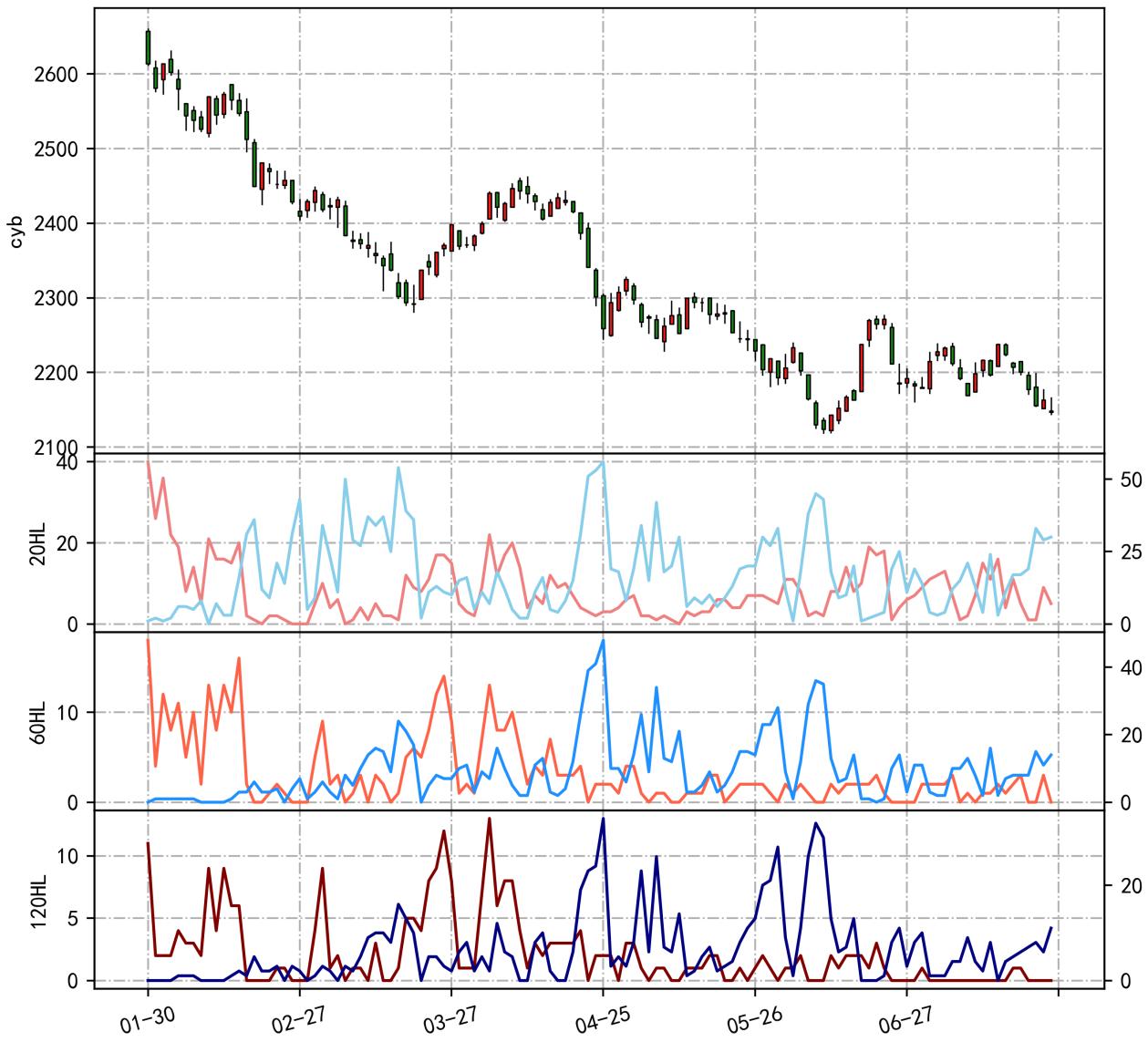


## 20-60-120日的新高新低数

- 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: 5 (26.3, **12.5**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 30 (52.7,53.6); 14 (29.2,29.2); 11 (32.4,32.4);



## 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: 10390 (59.2,31.8)
  2. 科创50: 2985 (**91.3,81.6**)



## 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: 3 (27.3, **20.0**); 0 (**0.0,0.0**); 0 (**0.0,0.0**);
- Low: 18 (63.0,62.1); 10 (41.7,41.7); 4 (**18.2,18.2**);



## 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: 1333 (**13.3, 13.3**)
- 恒生指数: 14044 (63.4, 51.7)



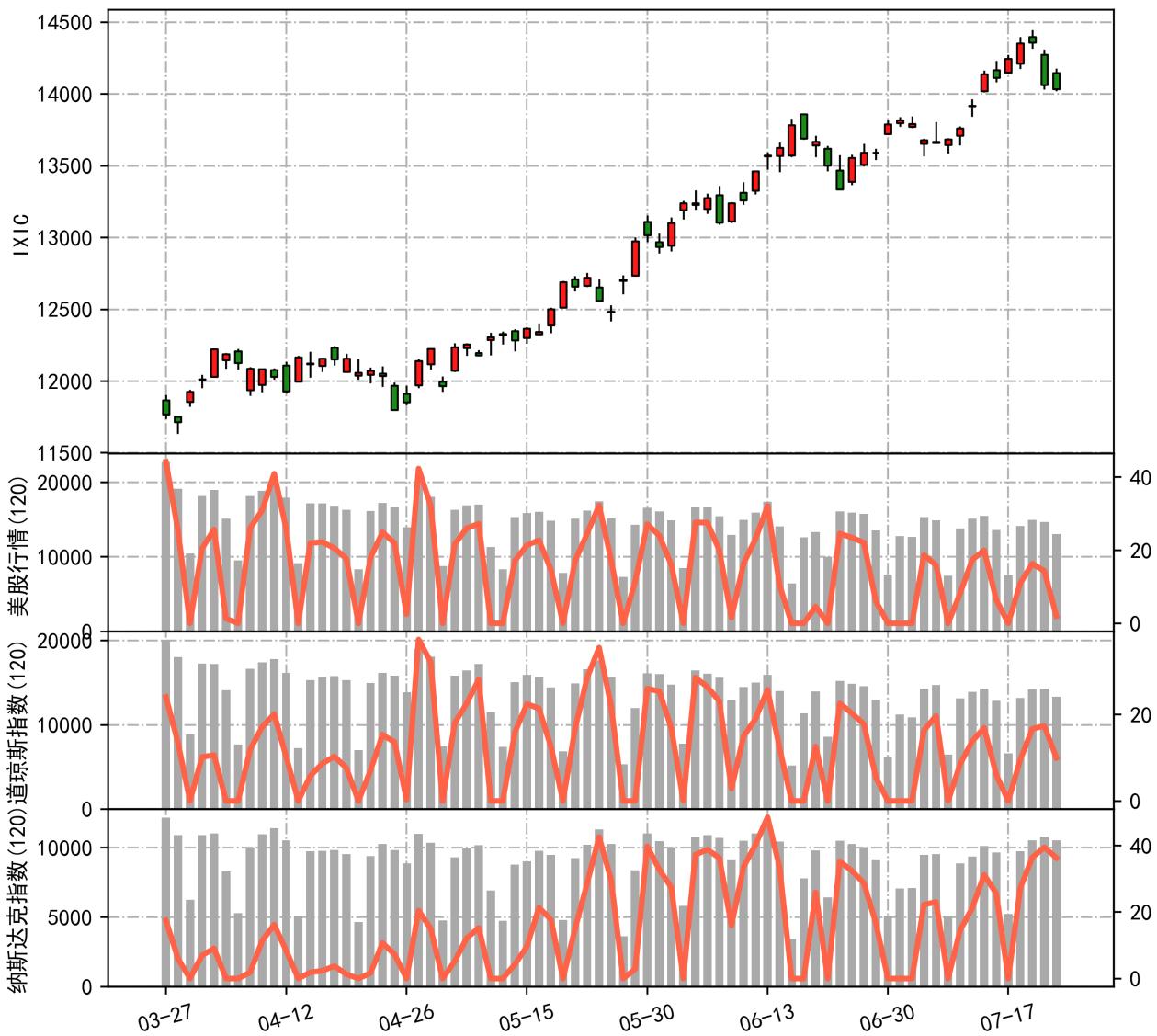
恒生科技指数: 9619 (55.3,56.9)



## 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: 13054 (27.3, **2.0**)
  2. 道琼斯指数: 13329 (38.8, **10.0**)
  3. 纳斯达克指数: 10536 (78.4, 36.4)



## 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: 893 (52.2,67.4)

