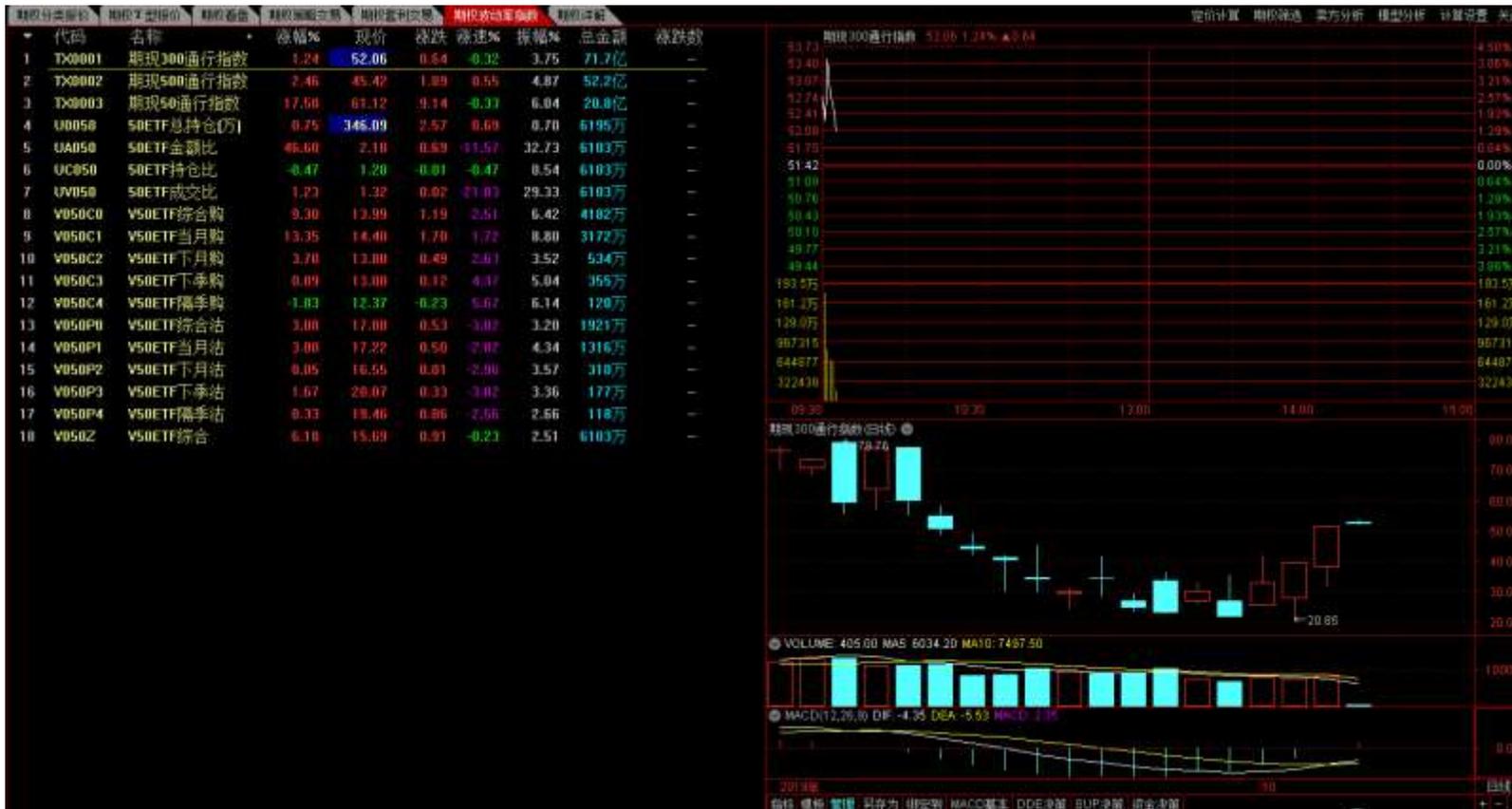


## 第1节 期现通行指数

### 1.1 指数编制规则

TX0001、TX0002、TX0003 为期现通行指数，分别根据沪深 300、中证 500、上证 50 三大股指的期货行情及现货行情综合统计的波动率指数，可反映 A 股的变动方向及变动程度。指数值在 0-100 内，0-20 可视为超卖区，80-100 可视为超买区。



## 1.2 指数名称及代码

指数代码	指数名称
TX0001	期现 300 通行指数
TX0002	期现 500 通行指数
TX0003	期现 50 通行指数

指数代码编制规则：

第 1-2 位：TX。表示通行指数类。

第 3-6 位：0001-0003。指数编号。

指数名称编制规则：

第 1-2 位：期现。表示期货和现货综合计算所得的指数。

中间位：300/500/50。指数类型，分别为沪深 300、中证 500、上证 50。

最后 4 位：通行指数。表示指数类型为通行指数。

## 1.3 指数精度

指数精度：保留 2 位小数。

## 1.4 指数报价频度

报价频度：3 秒左右 1 次。

### 1.5 指数行情内容

进入指数的 K 线图/分时图，可查看指数的具体行情数据，包括行情价格、总量、成交额、分笔成交数据等。

栏目	说明
行情价格	现价、昨收、今开、最高、最低、涨幅、振幅
总量	股指现货的成交量
成交额	股指现货的成交额
分笔数据	价格：波动率指数价格；数量：股指现货的成交量



## 第2节 期权市场统计指数

### 2.1 指数编制规则

U0050、UA050、UC050、UV050 为期权市场统计指数，分别根据所有合约的总持仓量（单位万）、认购认沽成交金额比、认购认沽持仓量比、认购认沽成交量比计算所得，可根据指数的数据判断期权市场的认购认沽成交对比情况。



## 2.2 指数名称及代码

指数代码	指数名称
U0050	50ETF 总持仓(万)
UA050	50ETF 金额比
UC050	50ETF 持仓比
UV050	50ETF 成交比

指数代码编制规则:

第 1 位: U。表示市场统计指数类。

第 2 位: 0/A/C/V。0 表示总持仓量, A 表示金额比, C 表示持仓比, V 表示成交比

第 3-5 位: 050。表示期权标的代码。

指数名称编制规则:

第 1-5 位: 50ETF。表示期权标的名称。

第 6-9 位: 总持仓(万)、金额比、持仓比、成交比。表示统计的具体内容。

## 2.3 指数计算方法

指数代码	指数名称	计算方式
U0050	50ETF 总持仓(万)	Sum(认购合约持仓量)+ Sum(认沽合约持仓量), 单位为万
UA050	50ETF 金额比	Sum(认购合约成交额)/ Sum(认沽合约成交额)
UC050	50ETF 持仓比	Sum(认购合约持仓量)/ Sum(认沽合约持仓量)
UV050	50ETF 成交比	Sum(认购合约成交量)/ Sum(认沽合约成交量)

## 2.4 指数精度

指数精度: 保留 2 位小数。

## 2.5 指数报价频度

报价频度：6-7 秒 1 次。

## 2.6 指数行情内容

进入指数的 K 线图/分时图，可查看指数的具体行情数据，包括行情价格、总量、成交额、分笔成交数据等。

栏目	说明
行情价格	现价、昨收、今开、最高、最低、涨幅、振幅
总量	所有合约的成交量之和
成交额	所有合约的成交额之和
分笔数据	价格：市场统计指数价格；数量：所有合约的成交量之和



### 第3节 期权波动率指数

#### 3.1 指数编制规则

V050C0、V050C1 等为期权波动率指数，分别根据各个类型下的单合约期权隐含波动率按照（成交量+持仓量）进行加权平均所得。总共包含 8 个单月指数和 3 个综合指数。8 个单月指数分别为 4 个月份 2 个方向的期权合约。3 个综合指数分别为：综合购、综合沽、综合。



### 3.2 指数名称及代码

类型	指数代码	指数名称	成分合约
单月指数	V050C1	V50ETF 当月购	当月认购合约
	V050C2	V50ETF 下月购	下月认购合约
	V050C3	V50ETF 下季购	下季认购合约
	V050C4	V50ETF 隔季购	隔季认购合约
	V050P1	V50ETF 当月沽	当月认沽合约
	V050P2	V50ETF 下月沽	下月认沽合约
	V050P3	V50ETF 下季沽	下季认沽合约
	V050P4	V50ETF 隔季沽	隔季认沽合约
综合指数	V050C0	V50ETF 综合购	4 个月份的所有认购合约
	V050P0	V50ETF 综合沽	4 个月份的所有认沽合约
	V050Z	V50ETF 综合	4 个月份所有认购合约和认沽合约

指数代码编制规则：

第 1 位：V。表示波动率指数 volatility。

第 2-4 位：050。表示标的指数/个股代码的后 3 位。

第 5 位：C/P/Z。C 表示认购期权，P 表示认沽期权，Z 表示认购认沽综合。

第 6 位：0, 1-4。0 表示综合指数，1 表示当月，2 表示下月，3 表示下季，4 表示隔季。

指数名称编制规则：

第 1 位：V。表示波动率指数 volatility。

倒数第 2-3 位：当月/下月/下季/隔季/综合。表示指数对应的期权成分合约到期类型，综合为所有到期月份。

最后 1 位：购/沽。表示指数对应的期权成分合约认购认沽类型。

第 2 位-倒数第 4 位：50ETF。标的名称，位数以标的名称实际位数为准。

### 3.3 指数计算方法

各个波动率指数，分别为成分合约的隐含波动率，按照（成交量+持仓量）进行加权平均所得。

$$V = \frac{\sum_{i=1}^n v_i * (cjl_i + ccl_i)}{\sum_{i=1}^n (cjl_i + ccl_i)}$$

其中：

V：指数波动率

$v_i$ ：第 i 个成分合约的隐含波动率

$cjl_i$ ：第 i 个合约的成交量

$ccl_i$ ：第 i 个合约的持仓量

n：成分合约数量

### 3.4 指数精度

指数精度：保留 2 位小数。

### 3.5 指数报价频度

报价频度：6-7 秒 1 次。

### 3.6 指数行情内容

进入指数的 K 线图/分时图，可查看指数的具体行情数据，包括行情价格、总量、成交额、分笔成交数据等。

栏目	说明
行情价格	现价、昨收、今开、最高、最低、涨幅、振幅
总量	所有成分合约的成交量之和
成交额	所有成分合约的成交额之和
分笔数据	价格：波动率指数价格；数量：成分合约的成交量之和

