

# 千际指数 策略和运行分析日报

指数事业部

021-68828928

hedgefund@foxmail.com

价格走势图



资料来源：千际咨询

## 相关报告：

1、《每日全市场策略和指数运行报告》

## 市场简报

2018/3/30 星期五

### 指数收益统计简述

#### 今日领涨指数

房地产原材料超额回报指数	涨幅	1.13%
优选全商品指数	涨幅	1.04%
农产品超额回报指数	涨幅	1.00%

#### 今日领跌指数

千际房地产股票指数	跌幅	-1.07%
千际50股票指数	跌幅	-0.54%
千际黄金股票指数	跌幅	-0.33%

## 全资产行情描述

### ——商品市场

2018年03月30日涨幅前三期货做多机会是DCE焦煤5.8%、DCE豆粕、SHFE螺纹钢,跌幅前三期货做空机会是SHFE白银、SHFE铝、SHFE黄金-0.2%。千际商品指数持仓量(万手)2915,双边成交量(万手)2998,成交量变化11110%。

### ——证券市场

#N/A

### ——债券市场

#N/A

### ——外汇市场

#N/A

### ——房地产市场

十大城市:商品房成交面积33.61万平方米,北京:商品房成交(签约)面积北京:商品房成交(签约)面积180平方米,上海:商品房成交套数上海:商品房成交

# 千际指数 策略和运行分析日报

## 指数事业部

021-68828928

hedgefund@foxmail.com

## 价格走势



资料来源：千际咨询

## 相关报告：

- 1、《每日全市场策略和指数运行报告》

套数 538 套，深圳：商品房成交套数深圳：商品房成交套数 102 套，深圳：商品房成交均价深圳：商品房成交均价 56214 元/平方米。

## 一、全资产系列指数

### 1. 千际全商品超额收益指数

A. 千际全商品超额收益指数（1X 做多）行情：



B. 金瑞千际全商品超额收益指数（1X 做多）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额收益指数	1224.216496	0.98%	1.19%	-10.44%

## 2. 千际 500 股票指数

### A. 千际 500 股票指数走势图：

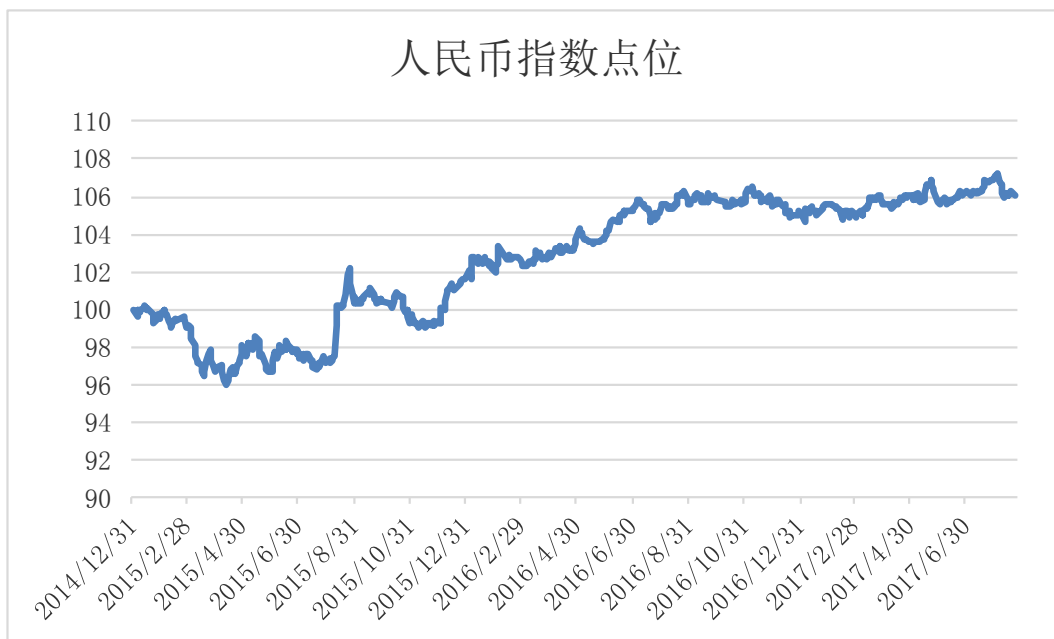


### B. 千际 500 股票指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际500股票指数	4094.20829	0.42%	1.51%	-1.69%

### 3. 千际人民币指数

A. 千际人民币指数走势图：

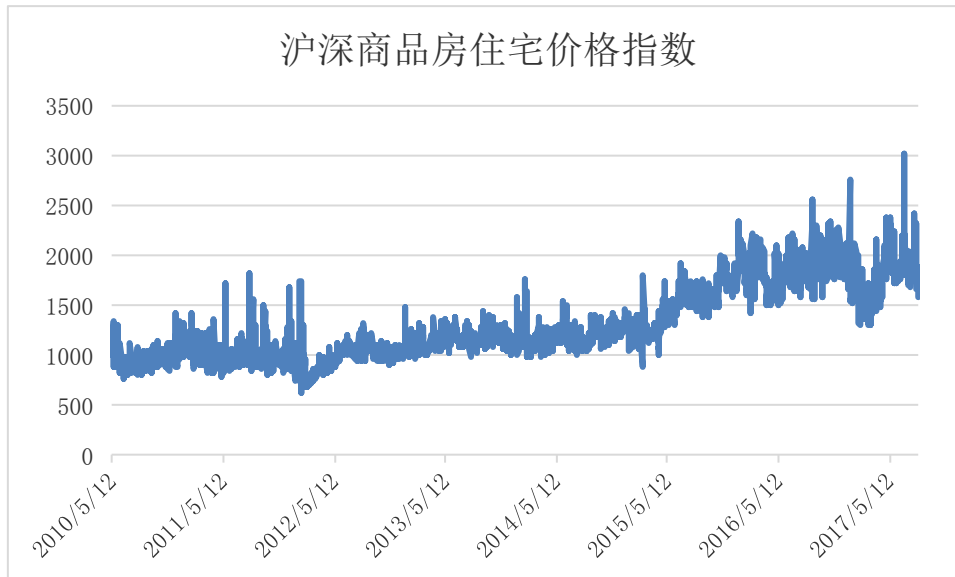


B. 千际人民币指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际人民币指数	102.0942702	-0.10%	-0.47%	-0.83%

#### 4. 千际沪深房价指数

A. 千际沪深房价指数走势图：

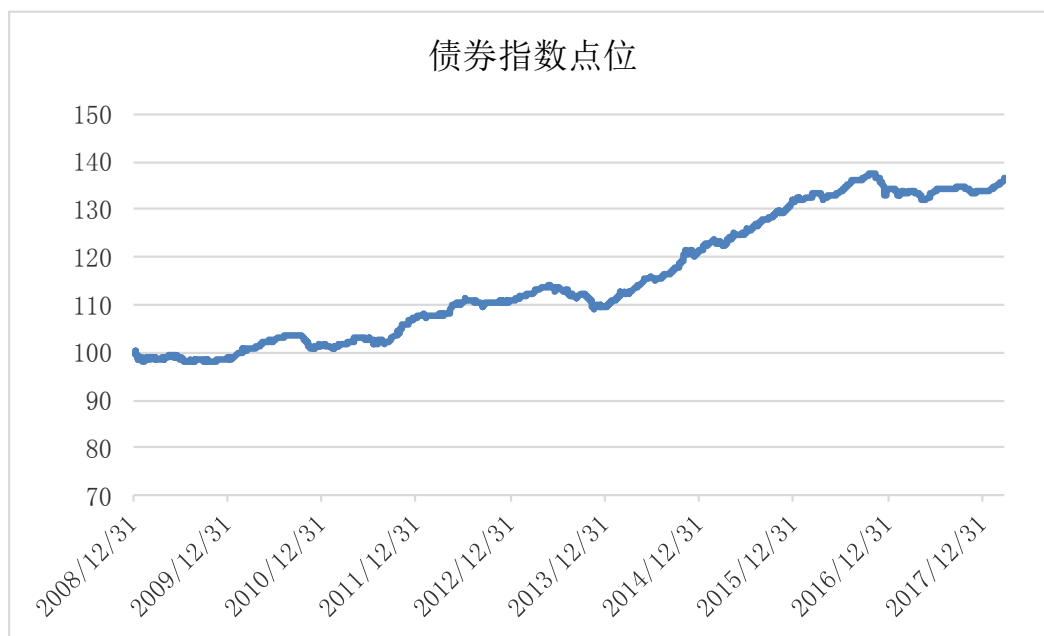


B. 千际沪深房价指数行情：

日期	2018/3/28			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
沪深商品房住宅价格指数	1972.349307	9.95%	6.93%	12.39%

## 5. 千际债券指数

### A. 千际债券指数走势图：



### B. 千际债券指数行情：

日期	2018/3/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际债券指数	136.6102607	0.02%	0.11%	0.89%

## 二、商品超额收益指数

### 1. 金瑞千际全商品超额收益指数

A. 金瑞千际全商品超额收益指数（1X 做多）走势图：



B. 金瑞千际全商品超额收益指数（1X 做多）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1224.216496	0.98%	1.19%	-10.44%

**C. 金瑞千际全商品超额收益指数（1X 做空）走势图：**

**D. 金瑞千际全商品超额收益指数（1X 做空）行情：**

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	604.322021	-0.98%	-1.19%	11.39%

## 2. 金瑞千际农产品超额收益指数

### A. 金瑞千际农产品超额收益指数（1X 做多）走势图：



### B. 金瑞千际农产品超额收益指数（1X 做多）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1001.105235	1.00%	0.13%	-2.14%

C. 金瑞千际农产品超额收益指数（1X 做空）走势图：



D. 金瑞千际农产品超额收益指数（1X 做空）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	816.6813404	-1.00%	-0.15%	2.15%

### 3. 金瑞千际房地产原材料超额收益指数

A. 金瑞千际房地产原材料超额收益指数（1X 做多）走势图：



B. 金瑞千际房地产原材料超额收益指数（1X 做多）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	2280.087511	1.13%	2.16%	-6.62%

C. 金瑞千际房地产原材料超额收益指数（1X 做空）走势图：



D. 金瑞千际房地产原材料超额收益指数（1X 做空）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	233.4729984	-1.13%	-2.13%	6.92%

#### 4. 金瑞千际能源化工超额收益指数

A. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做多）走势图：



B. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做多）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	974.6205637	0.64%	-1.16%	-4.70%

C. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）走势图：



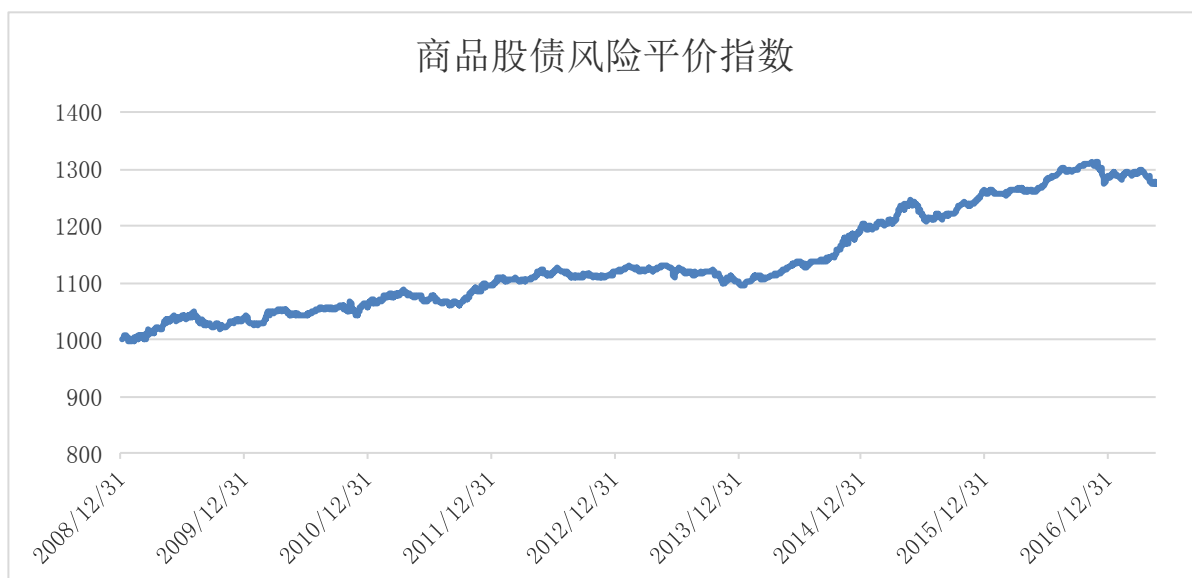
D. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	759.5044515	-0.64%	1.15%	4.86%

### 三、千际策略指数系列

#### 1. 商品股债风险平价指数

A. 商品股债风险平价指数走势图：



B. 商品股债风险平价指数行情：

日期	2018/3/29	商品股债风险平价指数	1302.28581		
	各类资产指数点位	各类资产权重	各类资产收益率	各类资产波动率	
沪深300指数	3894.0498	8.89%	1.33%	10.22%	
中证50债指	146.4468	83.02%	0.06%	1.21%	
千际全商品精选指数	1225.78161	8.09%	0.85%	11.42%	

## 2. 股债风险平价指数

### A. 股债风险平价指数走势图：



### B. 股债风险平价指数行情：

日期	2018/3/29	股债风险平价指数	1877.451108
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3894.0498	7.03%	1.33%
中证全债	178.6718	92.97%	0.03%

### 3. 目标 2050 指数

#### A. 目标 2050 指数走势图：



#### B. 目标 2050 指数行情：

日期	2018/3/30	目标2050指数	1402.193091
	权重	收益率	VaR
沪深300	22.08%	0.11%	2.00%
中证50债	51.31%	0.00%	0.08%
千际全商品指数	11.31%	1.38%	1.82%
黄金指数	17.92%	-0.33%	4.02%

#### 4. 股债风险控制指数

A. 股债风险控制指数走势图：



B. 股债风险控制指数行情：

日期	2018/3/29	股债风险控制指数	1805.981102
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3894.0498	45.21%	1.33%
中证全债	140.0798	54.79%	0.00%

## 5. 千际风险预算指数

A. 千际风险预算指数走势图：



B. 千际风险预算指数行情：

日期	2018/3/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
股债风险预算指数	2198.759923	0.57%	-0.12%	-3.19%

## 6. 千际多因子指数

### A. 千际多因子指数走势图:



### B. 千际多因子指数行情:

日期	2018/3/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际多因子指数	1229.423711	0.79%	0.02%	-3.96%

## 7. 千际农产品精选等手数指数

A. 千际农产品精选等手数指数走势图：

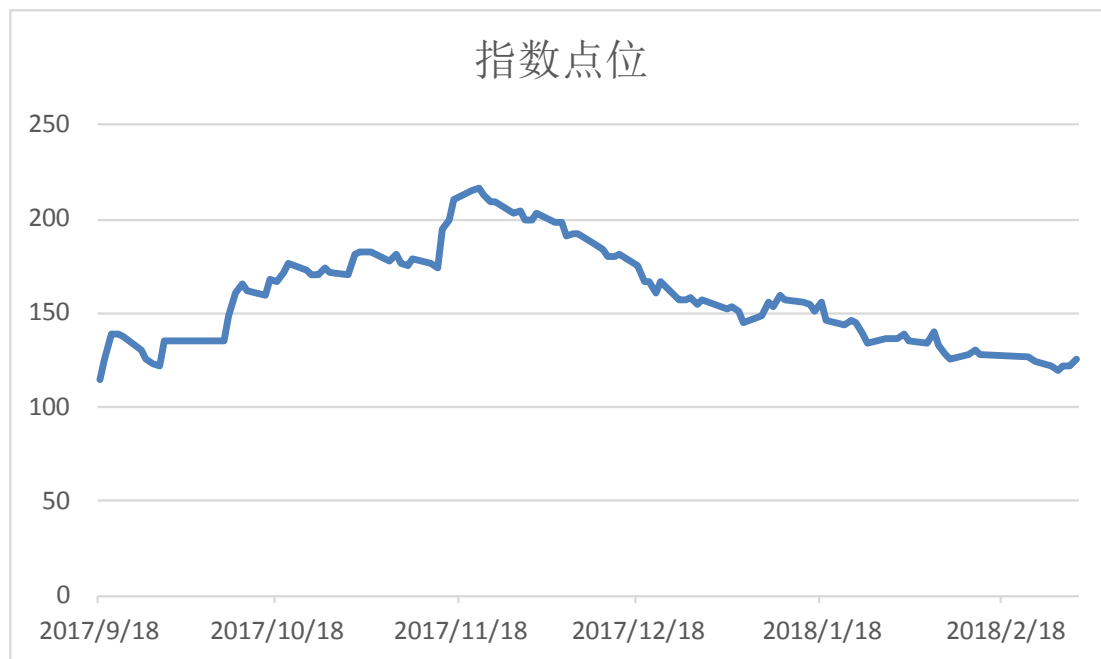


B. 千际农产品精选等手数指数行情：

日期	2018/3/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际农产品精选等手数指数	988.2661304	-0.55%	-1.13%	-2.76%

## 8. 千际豆粕期权 VIX 指数

A. 千际豆粕期权 VIX 指数走势图：



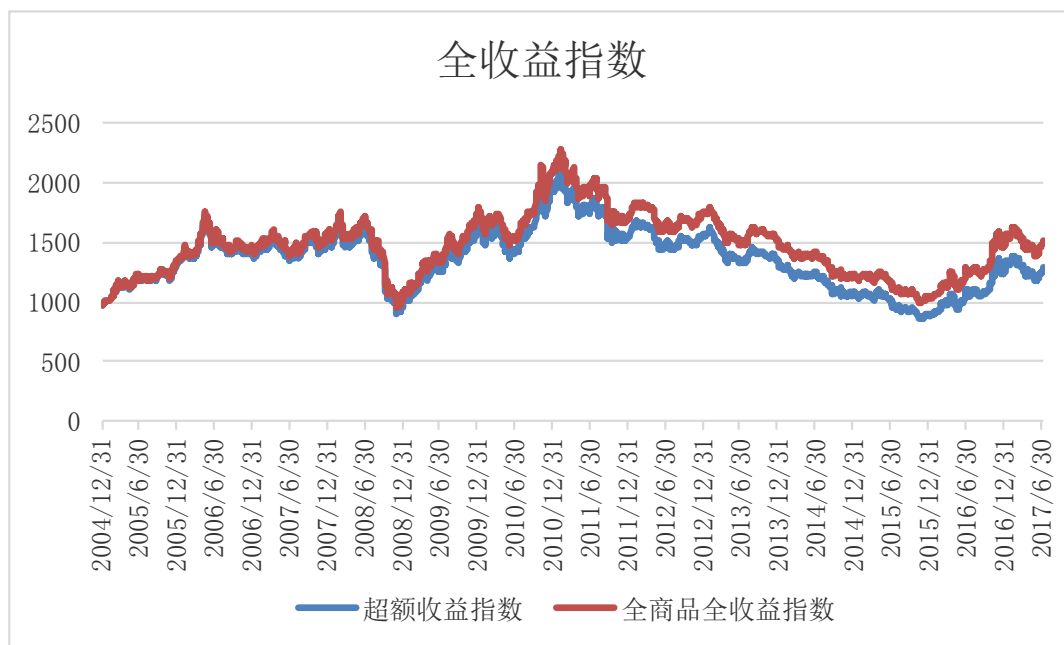
B. 千际豆粕期权 VIX 指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
豆粕期权VIX指数	116.6248255	-2.16%	-4.35%	-7.83%

## 四、千际全收益指数

### 1. 千际全收益指数

A. 超额收益与全收益指数走势图对比：



B. 超额收益与全收益指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
超额收益指数	1165.211952	1.06%	1.25%	-10.73%
全商品全收益指数	1392.01199	1.06%	1.27%	-10.63%

## 2. 千际美元计价全收益指数

### A. 千际美元计价全收益指数走势图：



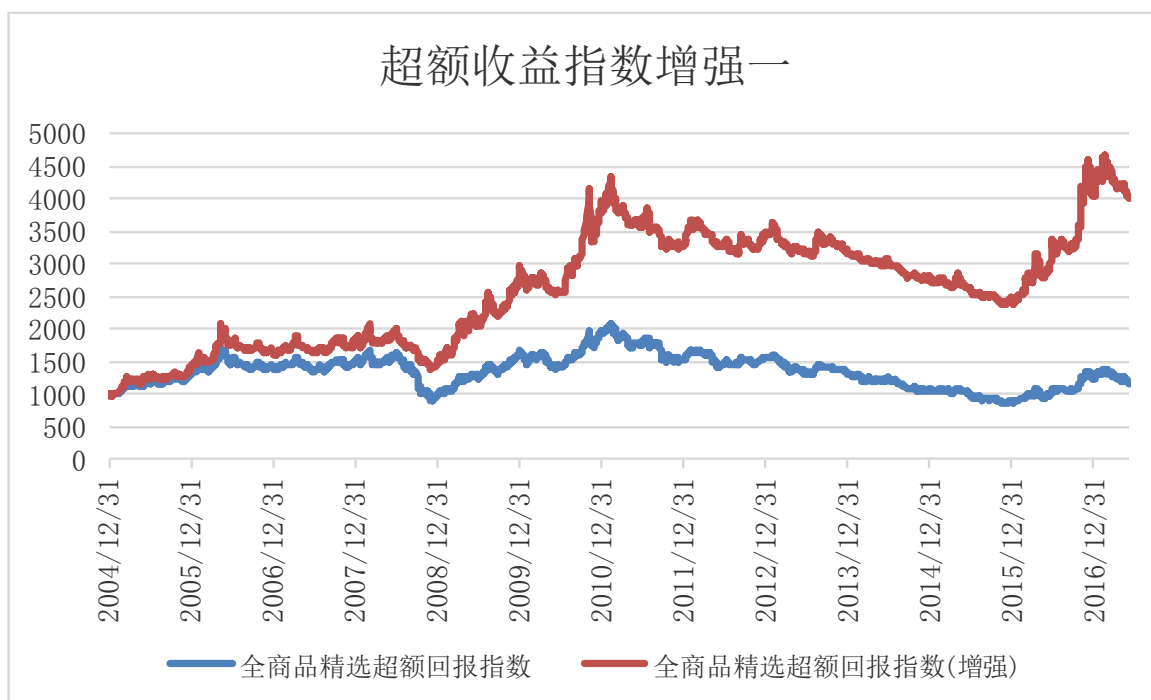
### B. 千际美元计价全收益指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品（美元计价）全收益指数	1386.884872	1.06%	1.26%	-10.65%

## 五、千际收益增强指数

### 1. 千际收益增强指数一

A. 千际收益增强指数一走势图：



B. 千际收益增强指数一行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额回报指数	1128.161673	0.99%	1.11%	-8.07%
全商品精选超额回报指数(增强)	4143.84011	0.50%	0.56%	-4.82%

## 六、千际期限结构指数

### 1. 全商品精选超额收益指数（短期）

A. 千际全商品精选超额收益指数（短期）走势图：



B. 千际全商品精选超额收益指数（短期）行情：

日期	2018/3/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额回报 指数(短期期限)	1250.63143	-0.12%	-1.55%	-9.20%

## 六、千际全商品均衡指数

### 1. 全商品均衡指数

A. 千际全商品均衡指数走势图：



B. 千际全商品均衡指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品均衡指数	1303.762469	0.94%	0.35%	-5.79%

## 七、千际股票指数

### 1. 千际 50 股票指数

#### A. 千际 50 股票指数走势图：



#### B. 千际 50 股票指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际50股票指数	3341.066881	-0.54%	0.44%	-9.83%

## 2. 千际黄金股票指数

A. 千际黄金股票指数走势图：



B. 千际黄金股票指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际黄金股票指数	8263.119923	-0.33%	-1.57%	1.93%

### 3. 千际房地产股票指数

A. 千际房地产股票指数走势图：



B. 千际房地产股票指数行情：

日期	2018/3/30			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际房地产股票指数	5654.483747	-1.07%	4.04%	-1.59%

## 八、易盛千际单品种指数

## 1. 单品种收益率指数、价格指数、成交量以及持仓量：

品种	日期	指数点位	涨跌幅	成交量	持仓量
强麦指数	2018/3/30	1704.177897	1.20%	84	528
普麦指数	2018/3/30	1135.646688	0.00%	0	0
棉指数	2018/3/30	1023.92638	0.97%	122754	261232
棉纱指数	2018/3/30	1005.422993	0.24%	0	6
糖指数	2018/3/30	1192.623814	1.11%	197154	360480
PTA指数	2018/3/30	635.9382313	0.85%	364346	847042
菜油指数	2018/3/30	714.7125395	1.60%	164676	280750
早籼稻指数	2018/3/30	1318.940137	-0.48%	0	0
甲醇指数	2018/3/30	866.1994264	0.93%	154528	211402
玻璃指数	2018/3/30	1057.505601	2.61%	94784	140186
菜籽指数	2018/3/30	989.6108803	0.73%	20	10
菜粕指数	2018/3/30	1067.973311	3.47%	702926	566738
动力煤指数	2018/3/30	1091.525424	0.42%	47552	111238
粳稻指数	2018/3/30	1048.165138	0.00%	14	140
晚籼稻指数	2018/3/30	1069.175627	-1.68%	2	0
硅铁指数	2018/3/30	1008.255934	1.03%	15962	23658
锰硅指数	2018/3/30	1172.595113	2.54%	12428	12676
玉米指数	2018/3/30	1464.315701	-0.06%	137364	487594
豆粕指数	2018/3/30	1659.485024	4.64%	3182996	2763344
豆油指数	2018/3/30	1142.631371	2.27%	495434	650552
棕榈油指数	2018/3/30	600.5223173	0.93%	343364	419670
聚丙烯指数	2018/3/30	817.6785214	0.30%	77312	234566
塑料指数	2018/3/30	735.9393698	0.05%	126242	246944
焦炭指数	2018/3/30	810.8589233	2.45%	147422	105024
铁矿石指数	2018/3/30	449.7971603	0.57%	1099960	891012
淀粉指数	2018/3/30	786.4468864	0.05%	65824	189782
豆一指数	2018/3/30	1910.714285	0.00%	110444	93618
豆二指数	2018/3/30	1337.735849	0.77%	8112	36390

鸡蛋指数	2018/3/30	854.4467426	2.99%	68574	89544
纤维板指数	2018/3/30	1272.413793	0.00%	0	6
胶合板指数	2018/3/30	1081.372158	0.30%	2	0
PVC指数	2018/3/30	991.5254236	2.22%	133100	155290
焦煤指数	2018/3/30	1035.974131	2.44%	104974	86720
橡胶指数	2018/3/30	940.8333333	1.71%	336264	328200
螺纹指数	2018/3/30	1008.70542	3.25%	3903414	2279344
锌指数	2018/3/30	853.6960985	-0.04%	208562	162458
铜指数	2018/3/30	1686.155914	0.60%	112732	227386
银指数	2018/3/30	589.2508144	0.44%	243604	786994
金指数	2018/3/30	1216.077027	0.18%	77390	316812
燃油指数	2018/3/30	1735.805861	0.00%	0	0
沥青指数	2018/3/30	644.7721182	1.19%	620556	408494
热轧卷板指数	2018/3/30	1129.090909	2.62%	235666	233832
线材指数	2018/3/30	1000.882872	0.00%	0	0
铅指数	2018/3/30	994.1906524	0.48%	7838	22716
铝指数	2018/3/30	697.21519	-0.36%	121936	235770
锡指数	2018/3/30	1213.04603	2.05%	2646	6388

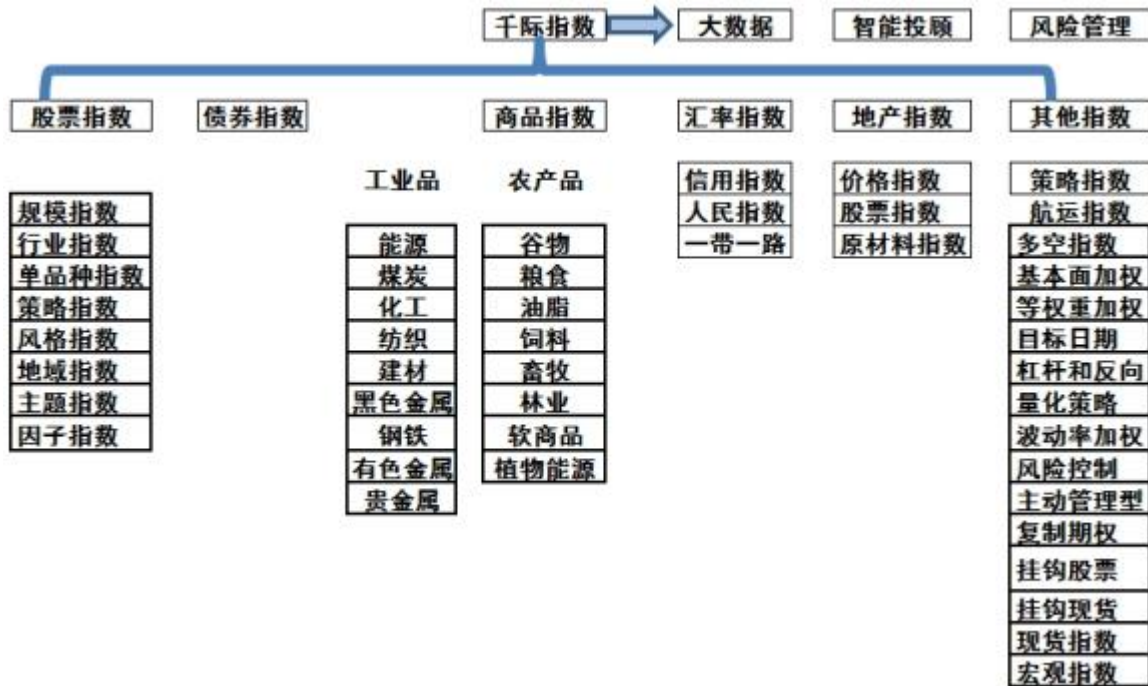
## 2. 单品种多空及杠杆指数

品种	日期	一倍 做多	两倍 做多	三倍 做多	五倍 做多	一倍 做空	两倍 做空	三倍 做空	五倍 做空
强麦指数	2018/3/30	1704.18	2338.86	2584.5	1639	472.3	179.27	54.564	2.5697
普麦指数	2018/3/30	1135.65	1105.92	919.31	382	756.9	492.89	275.87	54.273
棉指数	2018/3/30	1023.93	702.292	321.72	19.63	654.6	286.7	83.675	2.0483
棉纱指数	2018/3/30	1005.42	1007.98	1007.6	998.2	991.8	980.79	967.18	932.49
糖指数	2018/3/30	1192.62	917.632	454.97	29.4	540.3	187.34	41.423	0.5026
PTA指数	2018/3/30	635.938	247.31	58.441	0.701	964.7	571.02	206.82	6.051
菜油指数	2018/3/30	714.713	342.366	109.15	3.126	941.8	597.96	255.74	14.061
早籼稻指数	2018/3/30	1318.94	1553.88	1635.2	1289	677	408.95	220.19	44.915
甲醇指数	2018/3/30	866.199	555.821	263.68	23.57	855.5	541.49	252.81	21.634
玻璃指数	2018/3/30	1057.51	874.431	564.73	110.9	739.2	426.47	191.44	17.808
菜籽指数	2018/3/30	989.611	831.817	592.66	178.4	857.4	621.29	377.59	77.91
菜粕指数	2018/3/30	1067.97	901.624	600.75	129.4	740.5	433.28	199.94	20.579
动力煤指数	2018/3/30	1091.53	985.891	735.61	228	758.6	476.24	247.09	37.126
粳稻指数	2018/3/30	1048.17	994.282	853.89	466.3	862.4	671.07	469.76	164.79
晚籼稻指数	2018/3/30	1069.18	1064.43	986.9	683.8	870.3	703.84	527.93	234.14
硅铁指数	2018/3/30	1008.26	792.425	483.13	80.98	774.9	468.98	221.15	22.732
锰硅指数	2018/3/30	1172.6	1046.52	709.72	140.4	648.5	318.68	117.91	6.6035
玉米指数	2018/3/30	1464.32	1773.2	1775	1000	564.6	263.41	101.39	8.3683
豆粕指数	2018/3/30	1659.49	1285.94	462.83	5.756	281.8	37.019	2.2528	0.0008
豆油指数	2018/3/30	1142.63	807.721	350.85	14.72	543.6	183.84	38.632	0.4021
棕榈油指数	2018/3/30	600.522	210.4	42.662	0.323	976.2	559.57	188.08	4.1923
聚丙烯指数	2018/3/30	817.679	542.941	292.31	44.63	993.6	801.48	524.02	117.78
塑料指数	2018/3/30	735.939	303.917	69.842	0.601	765.8	330.75	80.292	0.8126
焦炭指数	2018/3/30	810.859	386.702	107.32	1.496	728	311.87	77.861	0.8872
铁矿石指数	2018/3/30	449.797	118.611	18.131	0.076	1309	1007.6	451.85	16.716
淀粉指数	2018/3/30	786.447	557.234	355.5	105.1	1146	1183.1	1100.1	692.03
豆一指数	2018/3/30	1910.71	2045.9	1222.1	73.29	293.8	48.414	4.4586	0.0064
豆二指数	2018/3/30	1337.74	1188.18	697.86	67.76	497.4	164.61	36.189	0.5041

鸡蛋指数	2018/3/30	854.447	599.537	345.05	62.37	961.1	757.54	488.5	109.34
纤维板指数	2018/3/30	1272.41	1206.43	840.11	135.4	588.6	259.22	84.846	3.5389
胶合板指数	2018/3/30	1081.37	881.505	541.8	86.55	695	360.73	138.51	7.7876
PVC指数	2018/3/30	991.525	746.582	426.39	60.02	765.8	444.82	195.44	16.06
焦煤指数	2018/3/30	1035.97	672.589	271.78	10.05	605.3	228.55	53.18	0.6171
橡胶指数	2018/3/30	940.833	188.872	7.8892	1E-04	229.4	11.334	0.1188	3E-08
螺纹指数	2018/3/30	1008.71	650.704	267.49	11.28	633.7	255.58	65.035	0.9975
锌指数	2018/3/30	853.696	365.123	77.301	0.389	590.9	176.42	26.538	0.0739
铜指数	2018/3/30	1686.16	956.722	180.55	0.217	200.4	13.54	0.3052	5E-06
银指数	2018/3/30	589.251	260.273	85.684	3.69	1276	1223.4	879.9	187.49
金指数	2018/3/30	1216.08	1051.78	643.88	82.89	586.4	245.37	73.171	2.3205
燃油指数	2018/3/30	1735.81	1268.38	382.97	2.167	244.9	25.515	1.1237	0.0002
沥青指数	2018/3/30	644.772	303.11	103.01	4.268	1137	950.74	584.6	86.791
热轧卷板指数	2018/3/30	1129.09	946.387	586.33	87.61	658.1	321.19	115.61	5.7779
线材指数	2018/3/30	1000.88	739.284	401.28	45.41	738.3	402.17	160.9	9.8526
铅指数	2018/3/30	994.191	775.238	473.01	82.79	789.5	488.74	236.66	26.045
铝指数	2018/3/30	697.215	297.698	77.503	1.156	880.3	475.7	157.48	3.8925
锡指数	2018/3/30	1213.05	1315.88	1276.3	855.5	737	485.22	285.04	69.361

## 公司简介

千际指数是中国国内指数数量类别最广、产品最多、服务最全、最具市场影响力的专业指数服务公司之一。我们提供 2000 多条系列指数，为投资者全面刻画金融资产和衍生品市场变化；涵盖规模指数、行业指数、单品种指数、主题指数、策略指数、地域指数、风格指数七大类别。并提供全方位的大宗商品、股票、债券、外汇、房地产和其他六大类指数服务体系。我们亦提供指数定制服务，最快两天完成编制！





上海千际投资管理咨询有限公司是一家大宗商品和衍生指数产品及其服务的供应商，千际指数是许多投资组合经理采用的基准指数。管理团队来自国内知名院校的学者和金融界的专业人士组成。

作为一家独立的第三方指数平台供应商，和经纪商以及金融机构互惠互利，共同推进指数市场的发展。提供指数发展的完整服务产品和支撑体系，让您能迅速达成合作运行。

1. 欢迎各大机构使用和研究分析千际指数，成为你的业绩基准和投资标的。
2. 欢迎和基金和资管机构发行指数基金产品。
3. 和证券、期货经纪公司、银行、第三方理财公司合作推广营销指数基金，亦可申请指数冠名和战略深度合作。
4. 和金融机构研究员和高校学者共同开发新指数。
5. 和各大机构进行信息技术，基金销售，基金做市业务等合作！……

千际指数

合作热线：021-50677069

合作和索取指数数据和研报发送 E-mail: [hedgefund@foxmail.com](mailto:hedgefund@foxmail.com)

<http://www.qindex.cn/>

## 免责声明

本报告中的信息均来源于已公开的资料，尽管我们相信报告中资料来源的可靠性，但我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。也不保证我公司所做出的意见和建议不会发生任何的变更，在任何情况下，我公司报告中的信息和所表达的意见和建议以及所载的数据、工具及材料均不能作为您所进行投资买卖的绝对依据。由于报告在编写时融入了该分析师个人的观点和见解以及分析方法，如与千际咨询公司发布的其他信息有不一致及有不同的结论，未免发生疑问，本报告所载的观点并不代表了千际咨询公司的立场，所以请谨慎参考。我公司不承担因根据本报告所进行期货买卖操作而导致的任何形式的损失。

另外，本报告所载资料、意见及推测只是反映千际咨询公司在本报告所载的日期的判断，可随时修改，毋需提前通知。未经千际咨询公司允许批准，本报告内容不得以任何形式传送、复印或派发此报告的材料、内容或复印本予以任何其他人，或投入商业使用。如遵循原文本意的引用、刊发，需注明出处“千际咨询公司”，并保留我公司的一切权利。



公司地址：上海市闸北区延长路 149 号上海大学科技园

电话：021-68828928

E-mail: [hedgefund@foxmail.com](mailto:hedgefund@foxmail.com)