

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

2018/5/29 星期二

指数收益统计简述

今日领涨指数

全商品超额回报指数	涨幅	0.98%
能源化工超额回报指数	涨幅	0.90%
房地产原材料超额回报指数	涨幅	0.70%

今日领跌指数

千际房地产股票指数	跌幅	-1.29%
千际500股票指数	跌幅	-0.86%
目标2050指数	跌幅	-0.45%

全资产行情描述

——商品市场

2018年05月28日涨幅前三期货做多机会是CZCE玻璃2.7%、DCE鸡蛋、SHFE锌,跌幅前三期货做空机会是CZCE PTA、SHFE沥青、DCE棕榈油-2.5%。千际商品指数持仓量(万手)3052,双边成交量(万手)2398,成交量变化9125%。

——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17.84万平方米,北京:商品房成交(签约)面积北京:商品房成交(签约)面积486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 424 套，深圳：商品房成交套数深圳：商品房成交套数 88 套，深圳：商品房成交均价深圳：商品房成交均价 50203 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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额收益指数	1297.3609	0.98%	1.14%	0.89%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际500股票指数	3979.643482	-0.86%	-1.77%	0.54%

3. 千际人民币指数

A. 千际人民币指数走势图：

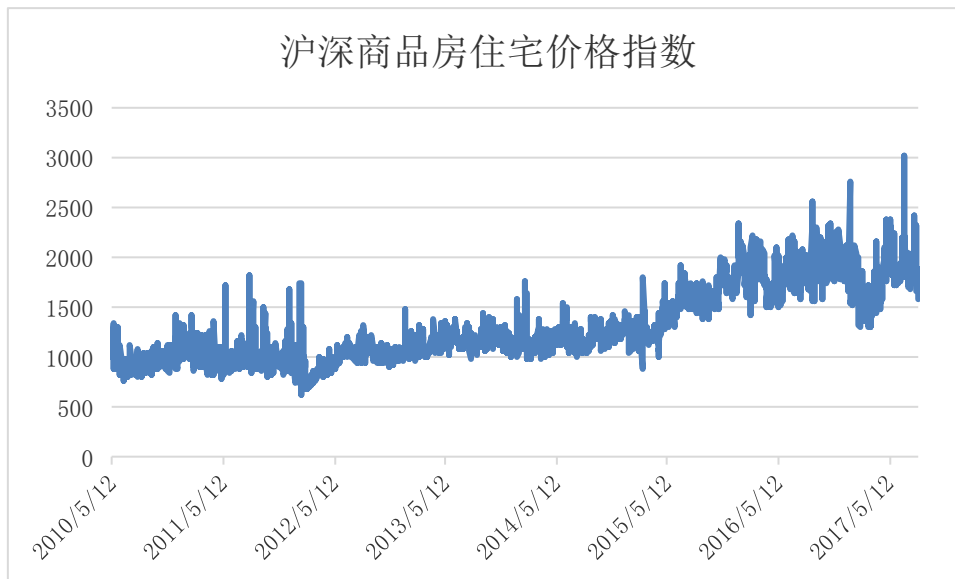


B. 千际人民币指数行情：

日期	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际人民币指数	101.9732069	0.00%	0.09%	-0.31%

4. 千际沪深房价指数

A. 千际沪深房价指数走势图：

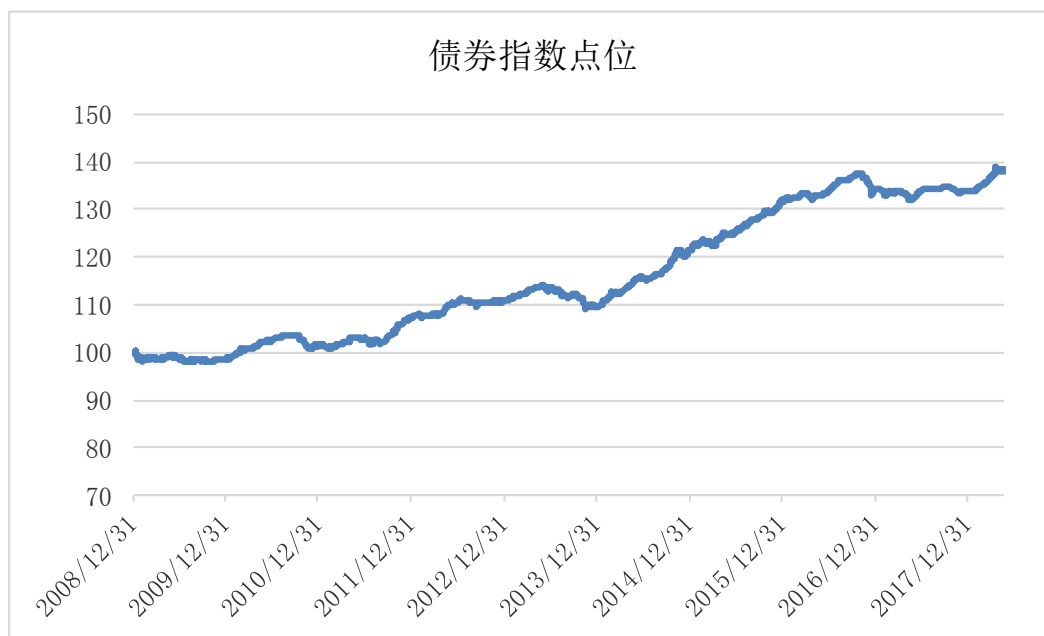


B. 千际沪深房价指数行情：

日期	2018/5/27			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
沪深商品房住宅价格指数	1991.275278	-13.81%	16.57%	3.80%

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	2018/5/28			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际债券指数	138.6676959	0.09%	0.27%	0.14%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1297.3609	0.98%	1.14%	0.89%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	569.0070188	-0.98%	-1.14%	-0.94%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1023.092557	0.36%	0.63%	1.34%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	798.3236558	-0.36%	-0.64%	-1.35%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	2418.778393	0.70%	1.18%	1.07%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	219.758758	-0.70%	-1.18%	-1.10%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1037.394596	0.90%	0.45%	2.48%

C. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）走势图：



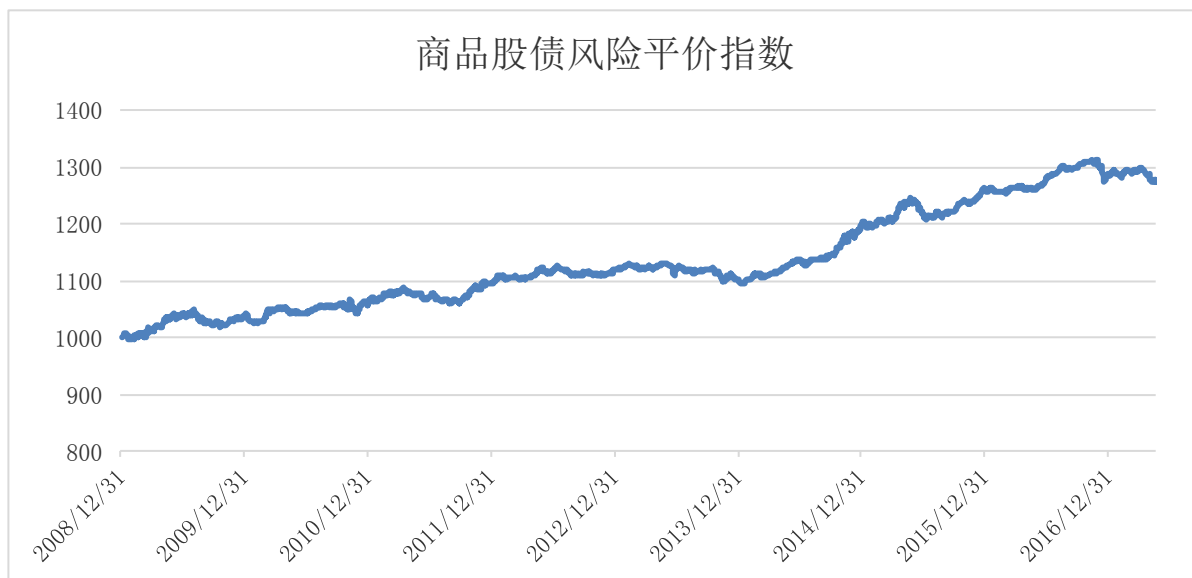
D. 金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）行情：

日期	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	712.4985232	-0.90%	-0.46%	-2.50%

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	2018/5/28	商品股债风险平价指数	1322.243137	
	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	3833.2599	8.70%	0.44%	12.08%
中证50债指	148.9017	82.77%	0.18%	1.44%
千际全商品精选指数	1291.895178	8.52%	0.12%	11.92%

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	2018/5/28	股债风险平价指数	1934.848784
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3833.2599	9.47%	0.44%
中证全债	181.3665	90.53%	0.12%

3. 目标 2050 指数

A. 目标 2050 指数走势图：

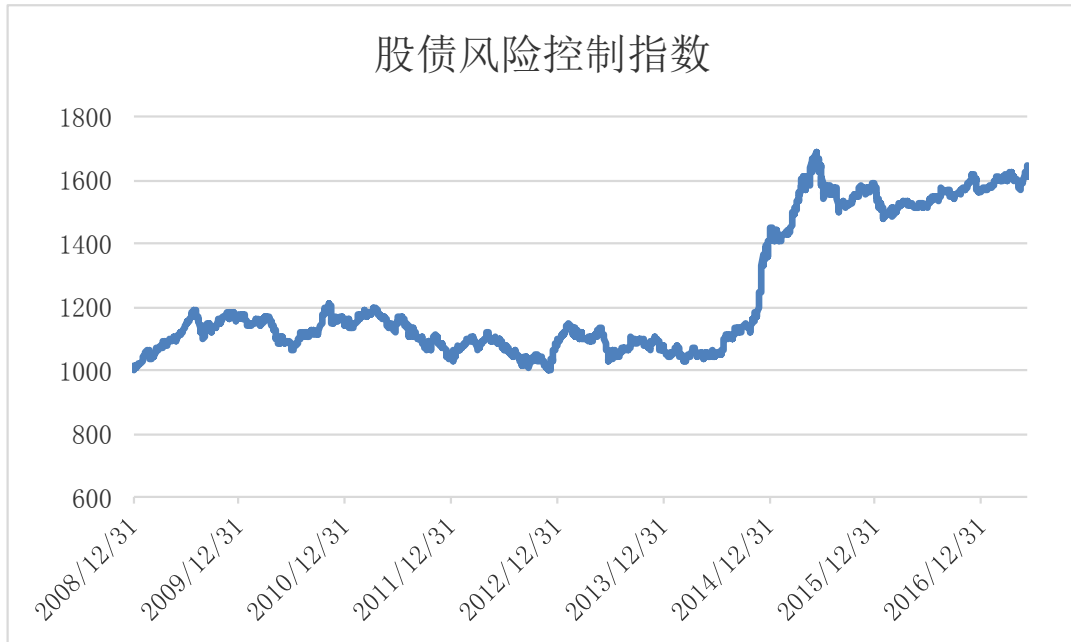


B. 目标 2050 指数行情：

日期	2018/5/29	目标2050指数	1387.358533
	权重	收益率	VaR
沪深300	20.89%	-0.77%	1.74%
中证50债	52.32%	0.13%	0.12%
千际全商品指数	12.32%	1.53%	1.97%
黄金指数	19.10%	0.08%	2.99%

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	2018/5/28	股债风险控制指数	1772.580527
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3833.2599	53.50%	0.44%
中证全债	137.7013	46.50%	0.04%

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	2018/5/28			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
股债风险预算指数	2219.137922	0.19%	-0.82%	1.68%

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	2018/5/28			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际多因子指数	1252.648187	0.22%	-0.57%	1.09%

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：

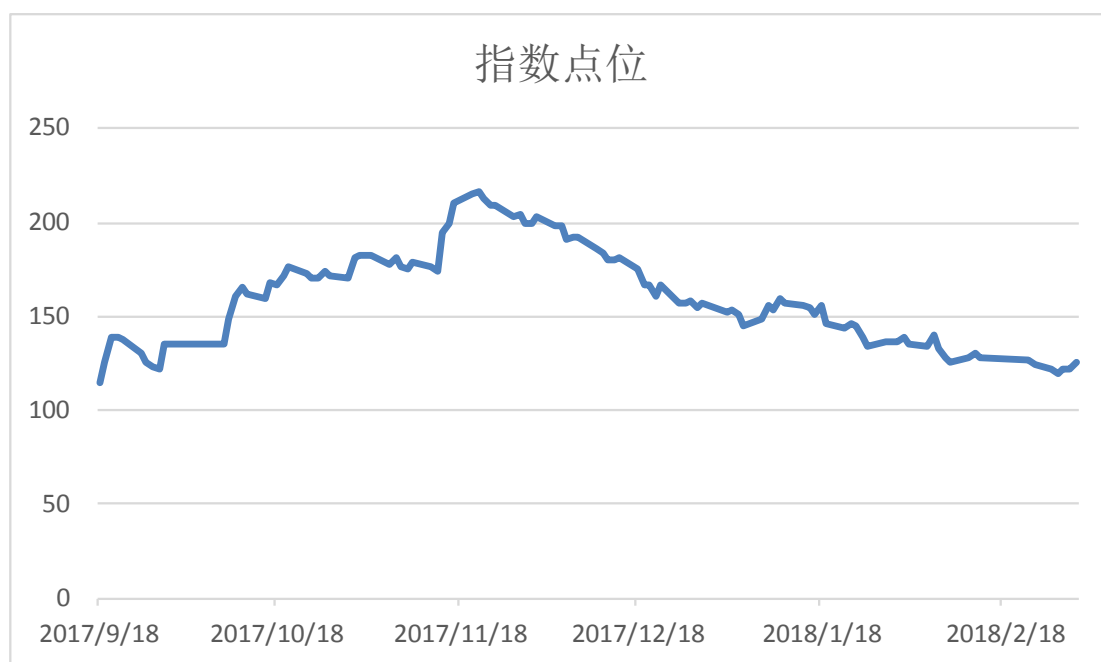


B. 千际农产品精选等手数指数行情：

日期	2018/3/30			
	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	999.7999557	1.17%	-0.30%	-1.85%

8. 千际豆粕期权 VIX 指数

A. 千际豆粕期权 VIX 指数走势图：



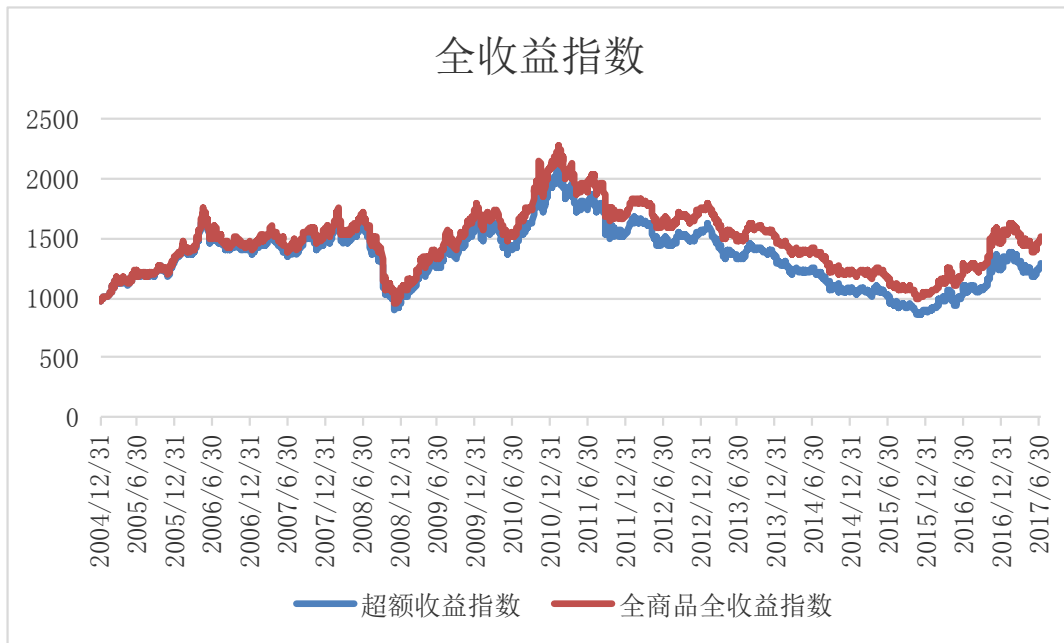
B. 千际豆粕期权 VIX 指数行情：

日期	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
豆粕期权VIX指数	109.521292	6.05%	-8.52%	0.97%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
超额收益指数	1297.360892	0.98%	1.14%	0.89%
全商品全收益指数	1553.174959	0.98%	1.16%	0.99%

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：



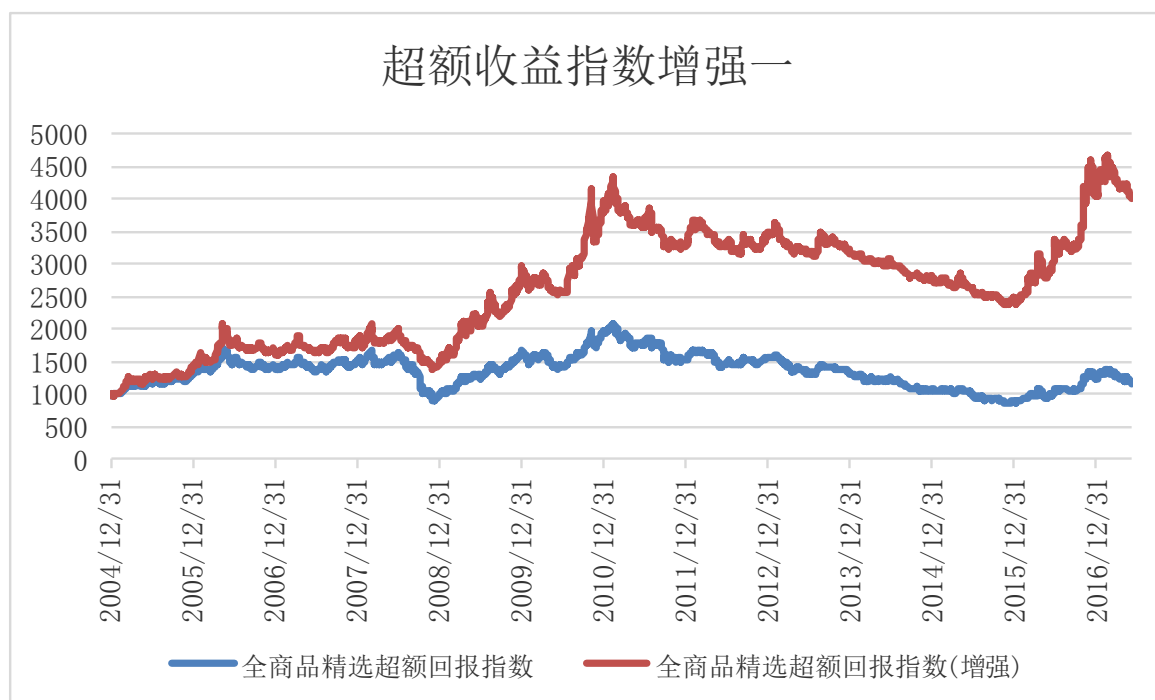
B. 千际美元计价全收益指数行情：

日期	2018/5/29			
	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	1547.193173	0.98%	1.16%	0.99%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额回报指数	1162.046126	0.72%	0.72%	0.38%
全商品精选超额回报指数(增强)	4159.70274	0.36%	0.36%	-0.91%

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	2018/5/29			
	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)	1456.03791	0.98%	1.14%	0.89%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品均衡指数	1330.225318	0.29%	0.33%	-0.69%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际50股票指数	3116.790067	-0.44%	-0.59%	-0.54%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际黄金股票指数	7424.945021	-0.05%	-2.66%	-4.04%

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	2018/5/29			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际房地产股票指数	5097.750922	-1.29%	-2.65%	-3.34%

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	2018/5/29	1712.938005	0.63%	1090	7506
普麦指数	2018/5/29	1169.89635	0.00%	0	0
棉指数	2018/5/29	1252.828902	4.83%	1163796	785036
棉纱指数	2018/5/29	1183.29718	4.18%	115458	18826
苹果指数	2018/5/29	1145.004312	2.29%	1182994	473108
糖指数	2018/5/29	1150.263435	0.13%	298582	592262
PTA指数	2018/5/29	666.1207301	0.11%	494046	1073006
菜油指数	2018/5/29	780.2172927	2.09%	570114	450214
早籼稻指数	2018/5/29	1194.308145	-0.90%	0	0
甲醇指数	2018/5/29	873.5266006	0.29%	393752	673980
玻璃指数	2018/5/29	1064.973861	0.14%	141540	267516
菜籽指数	2018/5/29	982.432943	0.00%	0	8
菜粕指数	2018/5/29	1067.139283	1.31%	669988	651102
动力煤指数	2018/5/29	1174.387947	1.93%	955874	380730
粳稻指数	2018/5/29	1047.837484	0.00%	0	102
晚籼稻指数	2018/5/29	1021.146953	1.32%	146	160
硅铁指数	2018/5/29	1137.942897	1.91%	223876	197152
锰硅指数	2018/5/29	1166.099598	1.86%	150382	113648
玉米指数	2018/5/29	1501.259446	0.22%	282724	843154
豆粕指数	2018/5/29	1616.395166	1.32%	1121916	2594106
豆油指数	2018/5/29	1146.977479	0.97%	314912	956146
棕榈油指数	2018/5/29	601.6144351	0.68%	280844	545764
聚丙烯指数	2018/5/29	861.7809892	1.30%	303648	432804
塑料指数	2018/5/29	737.1360191	0.71%	195522	449438
焦炭指数	2018/5/29	916.5554076	3.21%	536506	312086
铁矿石指数	2018/5/29	471.0953347	2.43%	2443562	1779078
淀粉指数	2018/5/29	815.7509157	0.09%	159788	319420
豆一指数	2018/5/29	1895.408163	0.46%	153850	230418

豆二指数	2018/5/29	1296.603773	1.09%	31654	98142
鸡蛋指数	2018/5/29	1072.905895	-0.19%	141564	148016
纤维板指数	2018/5/29	1272.413793	0.00%	0	6
胶合板指数	2018/5/29	1109.293977	-3.60%	8	6
PVC指数	2018/5/29	1030.046225	0.45%	151460	272388
焦煤指数	2018/5/29	985.0444625	1.84%	416726	295558
橡胶指数	2018/5/29	994.1666667	1.79%	682104	534696
螺纹指数	2018/5/29	1020.78068	1.56%	3950374	3028136
锌指数	2018/5/29	825.119781	0.88%	365982	223686
铜指数	2018/5/29	1737.567204	0.19%	179284	187898
银指数	2018/5/29	606.6775245	-0.08%	160070	705588
金指数	2018/5/29	1223.690103	0.33%	82968	334188
燃油指数	2018/5/29	1716.117216	0.00%	0	0
沥青指数	2018/5/29	698.8382487	0.26%	280950	391004
热轧卷板指数	2018/5/29	1166.969697	1.72%	719956	702714
线材指数	2018/5/29	1180.694526	0.00%	0	0
铅指数	2018/5/29	1059.677845	0.98%	109648	77094
铝指数	2018/5/29	745.5696203	-0.51%	147390	252734

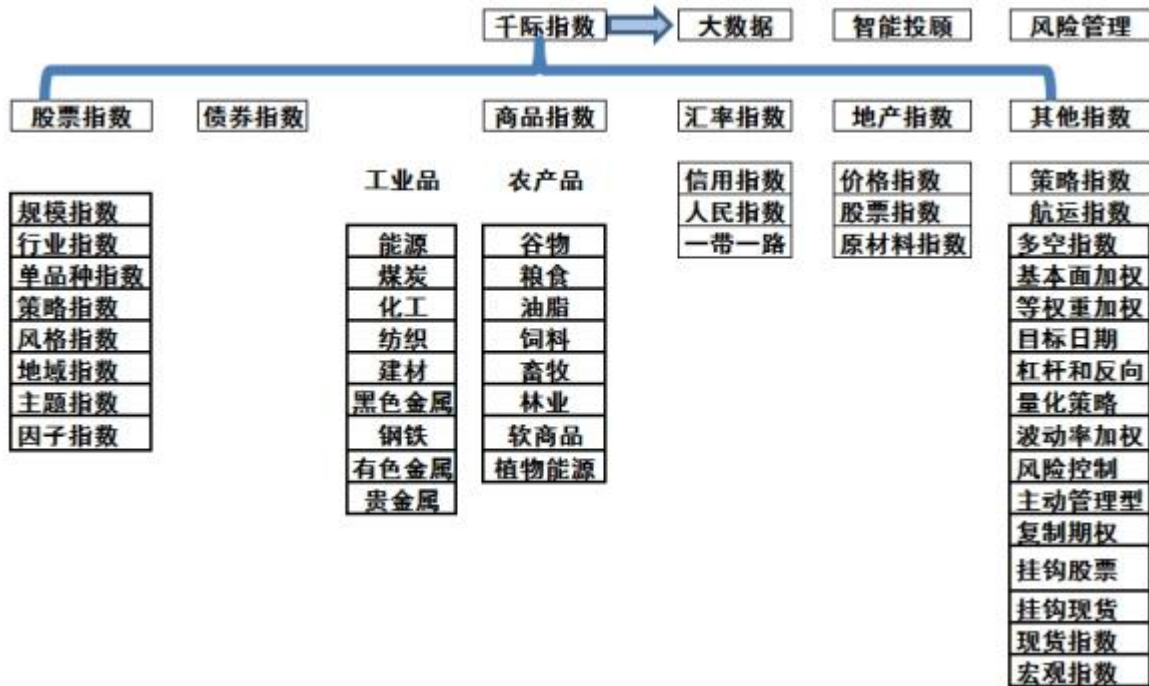
2. 单品种多空及杠杆指数

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	2018/5/29	1712.94	2356.04	2601.8	1635	468.4	175.82	52.744	2.3884
普麦指数	2018/5/29	1169.9	1162.23	975.45	398.9	727.9	451.47	238.4	40.481
棉指数	2018/5/29	1252.83	1044.3	577.71	50.5	531.1	187.3	43.65	0.6626
棉纱指数	2018/5/29	1183.3	1385.17	1604.7	2090	835.7	690.2	563.1	360.24
苹果指数	2018/5/29	1145	1273.14	1375.4	1474	847.4	696.07	553.37	314.61
糖指数	2018/5/29	1150.26	852.669	406.85	24.27	559.5	200.74	45.872	0.5925
PTA指数	2018/5/29	666.121	270.864	66.808	0.868	919.4	517.7	178.06	4.6732
菜油指数	2018/5/29	780.217	406.92	140.87	4.722	860.4	497.71	193.39	8.7021
早籼稻指数	2018/5/29	1194.31	1269.95	1202.1	757.9	745.3	494.21	291.26	70.621
甲醇指数	2018/5/29	873.527	562.713	266.77	23.48	844.5	525.32	239.96	19.394
玻璃指数	2018/5/29	1064.97	883.484	570.28	110.6	731.3	415.76	183.22	16.239
菜籽指数	2018/5/29	982.433	817.498	575.01	167.3	861.2	625.05	379.37	77.383
菜粕指数	2018/5/29	1067.14	895.729	590.46	122.7	737.3	427.39	194.35	19.113
动力煤指数	2018/5/29	1174.39	1131.07	891.9	300.5	698.7	400.35	187.82	22.417
粳稻指数	2018/5/29	1047.84	992.878	851.08	462	862	669.89	467.95	163.07
晚籼稻指数	2018/5/29	1021.15	961.239	833.95	489.5	902.4	749.5	571.97	255.39
硅铁指数	2018/5/29	1137.94	1000.53	676.56	136	680.4	358.21	145.52	10.765
锰硅指数	2018/5/29	1166.1	1028.17	684.38	127.9	647.8	315.81	115.12	6.125
玉米指数	2018/5/29	1501.26	1862.87	1909.9	1127	550.5	250.23	93.804	7.3321
豆粕指数	2018/5/29	1616.4	1213.45	420.84	4.783	287.7	38.385	2.3589	0.0008
豆油指数	2018/5/29	1146.98	812.553	353.14	14.76	540.7	181.55	37.816	0.3848
棕榈油指数	2018/5/29	601.614	210.793	42.668	0.32	972.7	554.61	185.1	4.0466
聚丙烯指数	2018/5/29	861.781	601.353	339.27	56.39	940	715.25	439.81	86.636
塑料指数	2018/5/29	737.136	304.421	69.848	0.597	763.4	328.11	79.145	0.7871
焦炭指数	2018/5/29	916.555	487.108	148.59	2.404	634.6	233.33	49.191	0.379
铁矿石指数	2018/5/29	471.095	128.455	20.052	0.084	1234	882.59	362.7	10.762
淀粉指数	2018/5/29	815.751	598.742	395.17	124.6	1103	1095.2	977.88	564.84
豆一指数	2018/5/29	1895.41	2007.52	1182.9	68.43	295.3	48.774	4.4884	0.0064

豆二指数	2018/5/29	1296.6	1111.17	626.83	55.38	510.8	172.83	38.668	0.55
鸡蛋指数	2018/5/29	1072.91	934.027	659.48	173.9	755.6	461.81	227.46	28.225
纤维板指数	2018/5/29	1272.41	1206.43	840.11	135.4	588.6	259.22	84.846	3.5389
胶合板指数	2018/5/29	1109.29	913.072	557.86	84	666.6	326.46	116.24	5.316
PVC指数	2018/5/29	1030.05	803.126	473.45	70.33	734.8	408.16	170.94	12.634
焦煤指数	2018/5/29	985.044	599.414	223.77	6.756	627.6	242.12	56.733	0.6384
橡胶指数	2018/5/29	994.167	208.808	9.0376	1E-04	214.9	9.8386	0.0945	2E-08
螺纹指数	2018/5/29	1020.78	661.563	271.26	11.14	621.6	244.11	60.027	0.8399
锌指数	2018/5/29	825.12	339.218	68.647	0.31	608	185.82	28.459	0.0809
铜指数	2018/5/29	1737.57	1014.72	196.85	0.249	194.3	12.704	0.2768	5E-06
银指数	2018/5/29	606.678	275.485	93.099	4.207	1237	1148.9	798.91	158.38
金指数	2018/5/29	1223.69	1064.39	654.93	85.03	582.4	241.92	71.571	2.2302
燃油指数	2018/5/29	1716.12	1239.76	370.07	2.047	247.7	26.103	1.1627	0.0002
沥青指数	2018/5/29	698.838	353.097	127.93	5.888	1040	787.85	434.63	50.265
热轧卷板指数	2018/5/29	1166.97	1004.32	634.7	96.75	632.6	294.76	100.62	4.4313
线材指数	2018/5/29	1180.69	951.306	535.77	59.13	540.6	144.35	-22.472	-15.791
铅指数	2018/5/29	1059.68	878.923	569.27	111.6	739.1	427.49	192.97	18.333
铝指数	2018/5/29	745.57	338.452	93.122	1.523	818.6	408.99	124.5	2.5591

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

<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