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

2018/4/11 星期三

指数收益统计简述

今日领涨指数

千际黄金股票指数	涨幅	4.07%
千际房地产股票指数	涨幅	1.03%
股债风险控制指数	涨幅	1.02%

今日领跌指数

农产品超额回报指数	跌幅	-0.53%
全商品均衡指数	跌幅	0.00%
千际人民币指数	跌幅	0.01%

全资产行情描述

——商品市场

2018 年 04 月 11 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

千际指数
策略和运行分析日报

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。

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》

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额收益指数	1250.547153	0.32%	0.54%	-3.87%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际500股票指数	4139.579388	0.38%	1.78%	-2.97%

3. 千际人民币指数

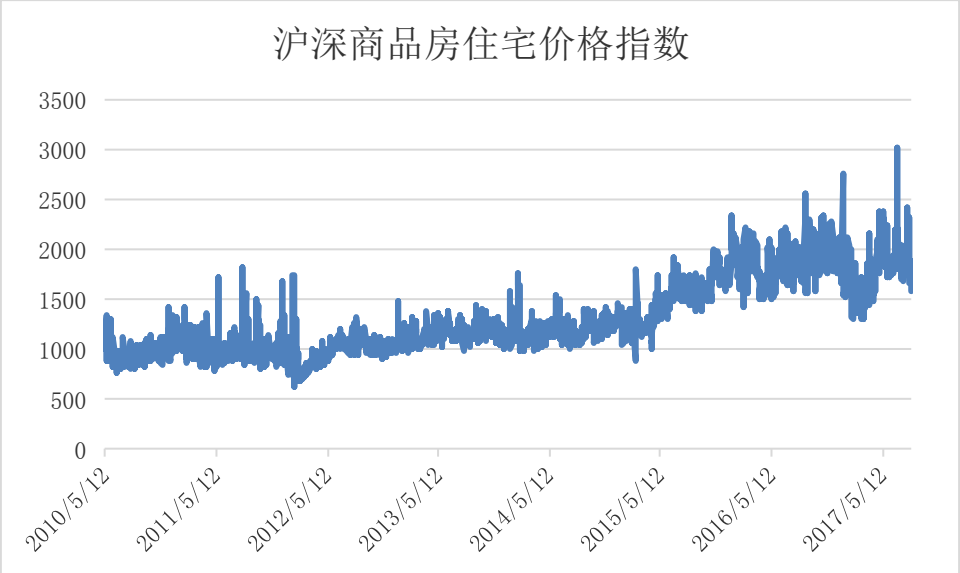
A. 千际人民币指数走势图：

B. 千际人民币指数行情：

日期	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际人民币指数	102.7342189	0.01%	0.47%	-0.08%

4. 千际沪深房价指数

A. 千际沪深房价指数走势图：

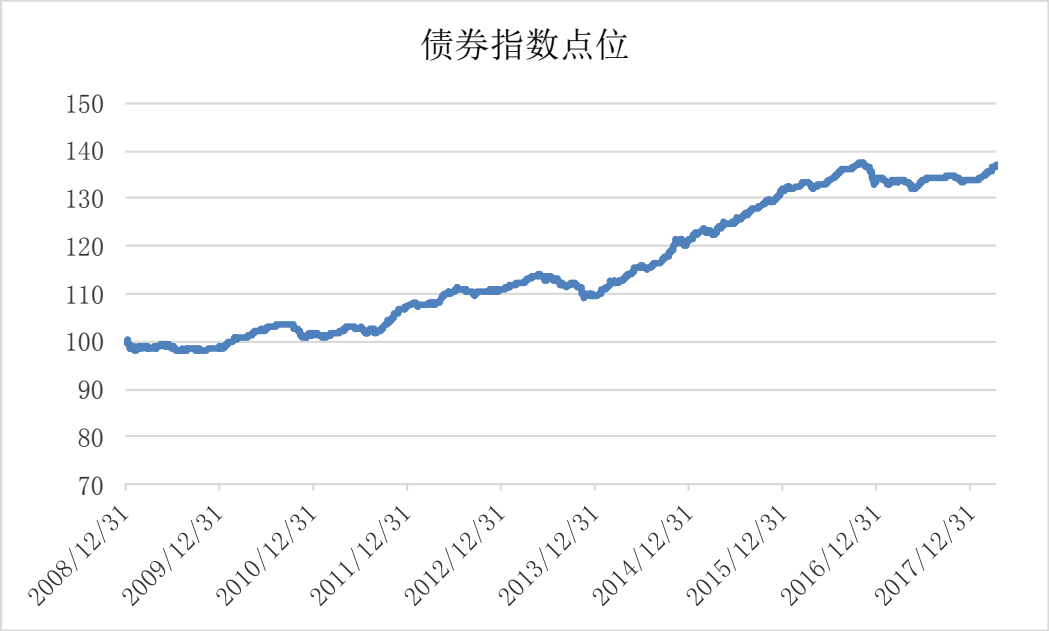


B. 千际沪深房价指数行情：

日期	2018/4/9			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
沪深商品房住宅价格指数	1856.649099	-15.64%	-10.05%	8.26%

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	2018/4/10			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际债券指数	137.3452758	0.04%	0.43%	1.23%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1250.547153	0.32%	0.54%	-3.87%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	591.3200727	-0.32%	-0.56%	3.79%

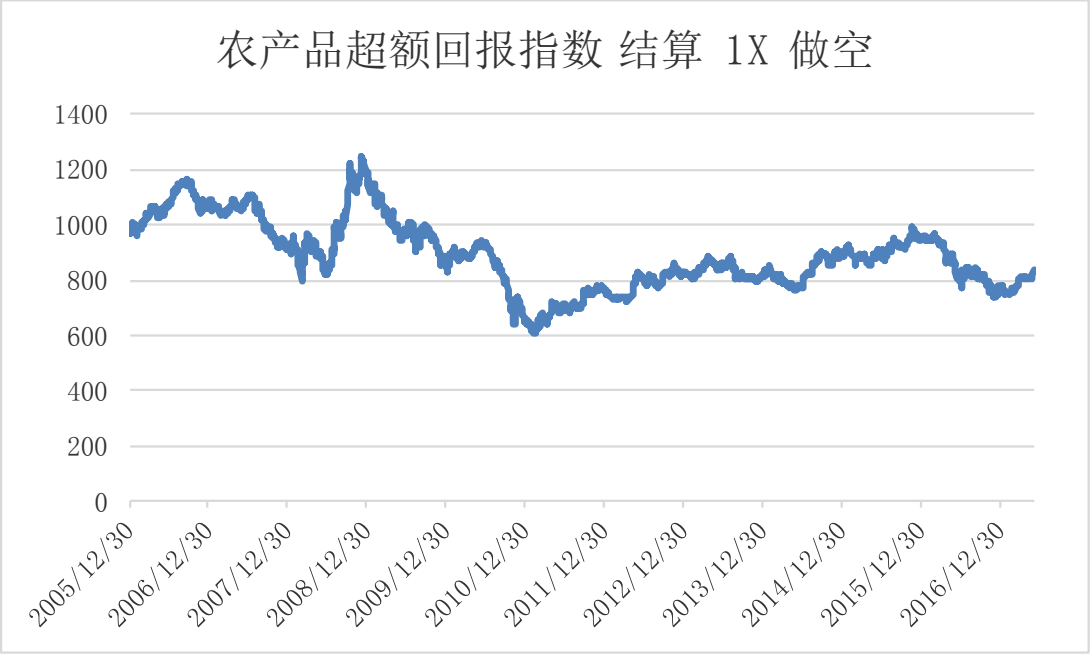
2. 金瑞千际农产品超额收益指数

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	1020.702608	-0.53%	1.10%	1.90%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	800.4870912	0.53%	-1.14%	-1.95%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	2334.696846	0.38%	0.99%	-0.92%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	227.9404868	-0.38%	-1.00%	0.79%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做多	979.500489	0.71%	1.03%	-2.49%

C.金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）走势图：

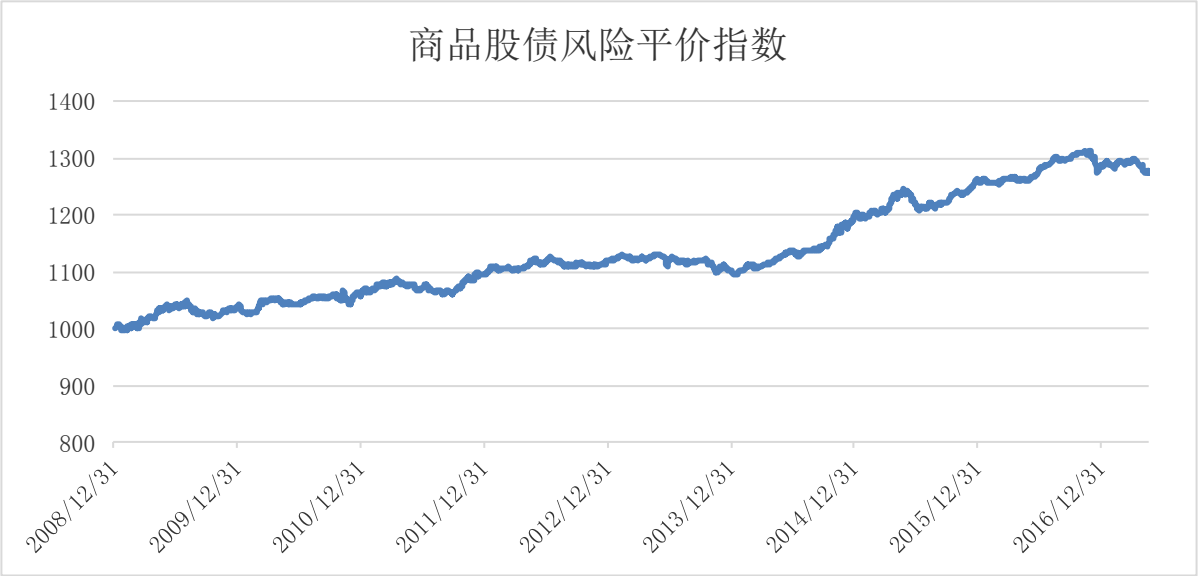
D.金瑞千际能源化工超额收益指数（1X 做空）行情：

日期	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
结算 1X 做空	755.5996518	-0.71%	-1.02%	2.48%

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	2018/4/10	商品股债风险平价指数	1313.457533	
	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	3927.1729	9.79%	1.91%	8.91%
中证50债指	147.2852	82.93%	0.03%	1.19%
千际全商品精选指数	1253.85042	7.28%	0.77%	12.33%

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	2018/4/10	股债风险平价指数	1898.269768
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3927.1729	7.65%	1.91%
中证全债	179.6336	92.35%	0.05%

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	2018/4/11	目标2050指数	1419.565997
	权重	收益率	VaR
沪深300	22.08%	0.28%	2.00%
中证50债	51.31%	0.00%	0.08%
千际全商品指数	11.31%	-0.44%	1.80%
黄金指数	17.92%	4.19%	4.04%

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	2018/4/10	股债风险控制指数	1807.269576
	指数点位	权重	收益率
沪深300	3927.1729	52.32%	1.91%
中证全债	140.4233	47.68%	0.03%

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	2018/4/10			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
股债风险预算指数	2193.937997	0.81%	0.68%	-1.39%

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	2018/4/10			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际多因子指数	1242.600153	1.02%	0.72%	-2.66%

7. 千际农产品精选等手数指数

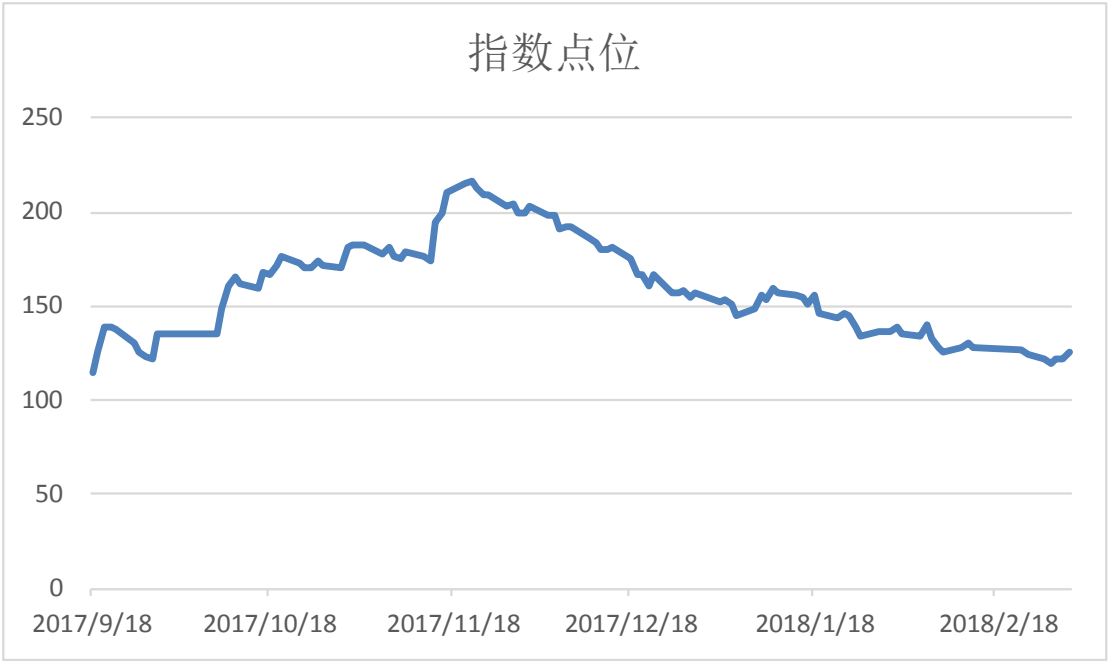
A. 千际农产品精选等手数指数走势图：

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：



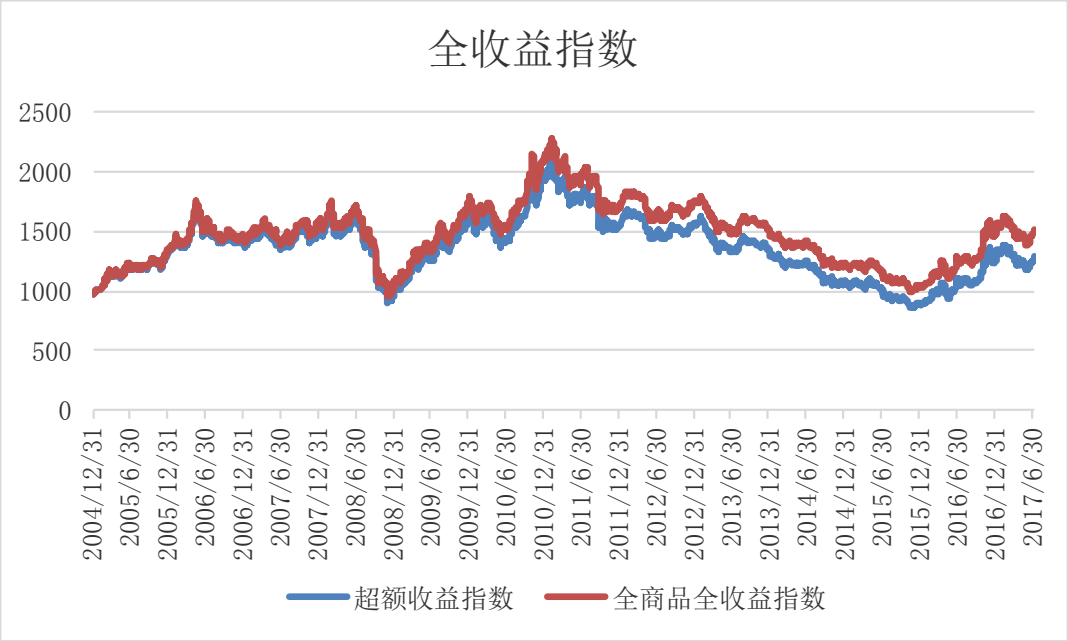
B. 千际豆粕期权 VIX 指数行情：

日期	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
豆粕期权VIX指数	101.481413	8.58%	-6.18%	-14.05%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
超额收益指数	1250.547153	0.32%	0.54%	-3.87%
全商品全收益指数	1494.453095	0.32%	0.57%	-3.77%

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：

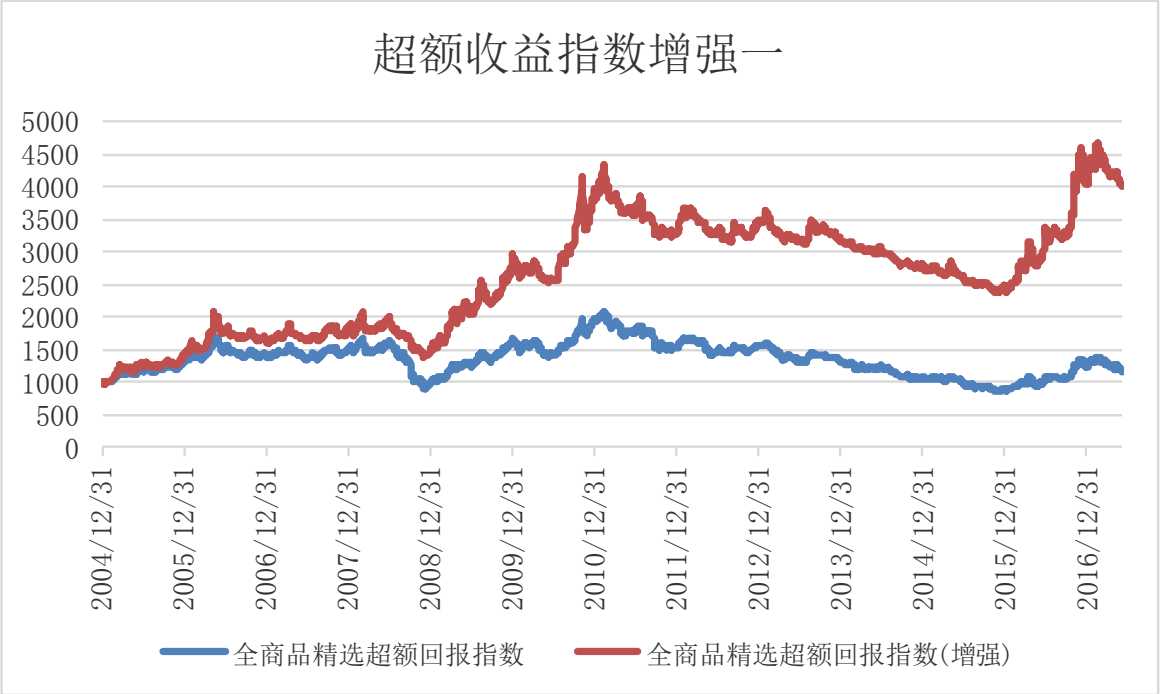
B. 千际美元计价全收益指数行情：

日期	2018/4/11			
	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	1488.629213	0.32%	0.56%	-3.79%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品精选超额回报指数	1148.57498	0.12%	0.61%	-2.75%
全商品精选超额回报指数(增强)	4181.286364	0.06%	0.31%	-1.37%

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	2018/4/11			
	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)	1403.500745	0.32%	0.55%	-3.87%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
全商品均衡指数	1330.728628	0.00%	0.86%	-0.42%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际50股票指数	3400.366937	0.65%	3.81%	-9.57%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际黄金股票指数	8859.25994	4.07%	3.96%	6.93%

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	2018/4/11			
	指数点位	日涨幅	周涨幅	月涨幅
千际房地产股票指数	5695.190528	1.03%	1.51%	-1.89%

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	2018/4/11	1681.940701	-0.56%	48	864
普麦指数	2018/4/11	1177.106805	0.00%	0	0
棉指数	2018/4/11	1045.330607	0.26%	141842	306626
棉纱指数	2018/4/11	1011.062907	0.00%	0	6
糖指数	2018/4/11	1173.024236	-0.20%	225522	423600
PTA指数	2018/4/11	638.7459056	0.52%	630342	1003918
菜油指数	2018/4/11	746.2652783	-0.27%	150124	279182
早籼稻指数	2018/4/11	1309.126595	-2.45%	0	0
甲醇指数	2018/4/11	826.6964	0.19%	431626	407086
玻璃指数	2018/4/11	1008.961912	0.60%	146792	200088
菜籽指数	2018/4/11	1015.678126	-1.07%	20	14
菜粕指数	2018/4/11	1120.100083	0.00%	737742	646494
动力煤指数	2018/4/11	1059.510358	-0.28%	176034	191654
粳稻指数	2018/4/11	1048.165138	0.00%	0	98
晚籼稻指数	2018/4/11	1157.34767	0.00%	0	0
硅铁指数	2018/4/11	1013.75989	0.27%	34688	43468
锰硅指数	2018/4/11	1096.195484	-0.73%	13954	16998
玉米指数	2018/4/11	1470.193115	0.10%	203904	970540
豆粕指数	2018/4/11	1706.253285	-0.12%	2380494	3024840
豆油指数	2018/4/11	1165.547215	-0.84%	493598	823156
棕榈油指数	2018/4/11	607.5498577	-0.47%	299152	448060
聚丙烯指数	2018/4/11	848.7379189	-0.58%	269890	329278
塑料指数	2018/4/11	741.9226167	-0.05%	250058	332602
焦炭指数	2018/4/11	776.8135294	-2.38%	490634	264898
铁矿石指数	2018/4/11	453.8539554	-0.78%	3074554	1824952
淀粉指数	2018/4/11	776.5567765	0.33%	123320	271214
豆一指数	2018/4/11	2026.530612	-0.45%	140158	185948
豆二指数	2018/4/11	1390.943396	-0.41%	133304	78802

鸡蛋指数	2018/4/11	1045.501551	0.77%	58570	107078
纤维板指数	2018/4/11	1272.413793	0.00%	0	6
胶合板指数	2018/4/11	997.6067012	0.00%	0	0
PVC指数	2018/4/11	1014.637904	-0.90%	248994	235384
焦煤指数	2018/4/11	929.2643493	-1.71%	298430	211840
橡胶指数	2018/4/11	956.6666667	-0.86%	466266	421774
螺纹指数	2018/4/11	953.383881	-0.70%	5117786	2774720
锌指数	2018/4/11	841.2046543	0.33%	476456	222172
铜指数	2018/4/11	1717.069892	-0.14%	186814	229850
银指数	2018/4/11	595.2768731	0.41%	259782	720700
金指数	2018/4/11	1228.392298	0.59%	144666	317112
燃油指数	2018/4/11	1723.901099	0.00%	0	0
沥青指数	2018/4/11	629.5799823	0.14%	411416	335568
热轧卷板指数	2018/4/11	1054.242424	-1.47%	637208	384214
线材指数	2018/4/11	865.509123	0.00%	0	0
铅指数	2018/4/11	969.8970163	-0.03%	15506	25618
铝指数	2018/4/11	727.8481013	0.17%	311348	306450
锡指数	2018/4/11	1226.209441	-0.40%	3498	9094

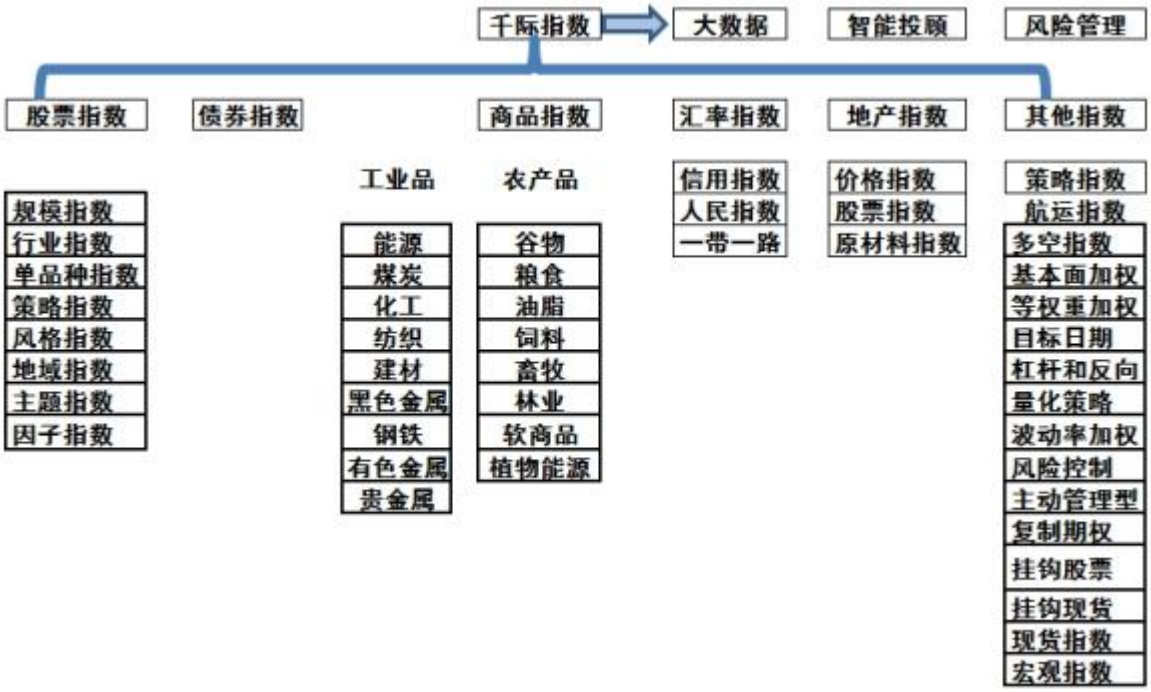
2. 单品种多空及杠杆指数

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	2018/4/11	1681.94	2277.73	2483.1	1532	478.4	183.92	56.686	2.7355
普麦指数	2018/4/11	1177.11	1187.79	1022.8	455.6	730.1	458.37	247.28	45.156
棉指数	2018/4/11	1045.33	731.899	342.23	21.75	641.1	275.01	78.599	1.8446
棉纱指数	2018/4/11	1011.06	1019.06	1023.9	1024	986	969.13	949.6	903.21
糖指数	2018/4/11	1173.02	887.596	432.72	27.03	549.2	193.58	43.499	0.5449
PTA指数	2018/4/11	638.746	249.438	59.175	0.715	960.2	565.6	203.81	5.8975
菜油指数	2018/4/11	746.265	373.027	124.02	3.857	901.4	547.38	223.76	11.215
早籼稻指数	2018/4/11	1309.13	1529.63	1595.2	1231	681.5	414.16	224.16	46.111
甲醇指数	2018/4/11	826.696	505.71	228.44	18.44	895.4	592.55	288.95	26.893
玻璃指数	2018/4/11	1008.96	795.323	489.22	86.94	774.1	467.36	219.37	22.263
菜籽指数	2018/4/11	1015.68	875.397	638.96	201.3	834.6	588.08	347.19	67.381
菜粕指数	2018/4/11	1120.1	990.21	689.84	161.8	704.8	391.87	171.49	15.776
动力煤指数	2018/4/11	1059.51	928.485	671.84	195.5	781.1	504.79	269.47	42.808
粳稻指数	2018/4/11	1048.17	994.282	853.89	466.3	862.4	671.07	469.76	164.79
晚籼稻指数	2018/4/11	1157.35	1245.69	1247.2	1004	803	598.36	412.98	154.42
硅铁指数	2018/4/11	1013.76	800.968	490.84	83.08	770.5	463.67	217.35	22.066
锰硅指数	2018/4/11	1096.2	913.608	577.94	99.13	693	363.52	143.44	9.1099
玉米指数	2018/4/11	1470.19	1787.27	1795.9	1019	562.3	261.23	100.12	8.1895
豆粕指数	2018/4/11	1706.25	1356.86	500.23	6.493	273.5	34.811	2.0479	0.0007
豆油指数	2018/4/11	1165.55	839.9	371.67	16.15	532.6	176.33	36.249	0.3603
棕榈油指数	2018/4/11	607.55	215.289	44.138	0.342	964.6	546.21	181.3	3.937
聚丙烯指数	2018/4/11	848.738	584.533	326.18	53.38	956.5	742.15	466.35	96.561
塑料指数	2018/4/11	741.923	308.798	71.503	0.625	759.5	325.18	78.24	0.7773
焦炭指数	2018/4/11	776.814	354.504	94.032	1.193	759	338.7	87.986	1.0823
铁矿石指数	2018/4/11	453.854	120.573	18.54	0.078	1296	985.12	435.8	15.618
淀粉指数	2018/4/11	776.557	543.059	341.78	98.24	1160	1211.8	1139.6	732.28
豆一指数	2018/4/11	2026.53	2298.39	1452.4	97.11	276.6	42.858	3.7052	0.0047
豆二指数	2018/4/11	1390.94	1281.62	779.09	80.48	477.2	151.19	31.744	0.4003

鸡蛋指数	2018/4/11	1045.5	890.437	617.47	158.9	778.5	492.31	251.95	34.201
纤维板指数	2018/4/11	1272.41	1206.43	840.11	135.4	588.6	259.22	84.846	3.5389
胶合板指数	2018/4/11	997.607	749.193	423.61	57.01	752.3	422.18	175.04	11.433
PVC指数	2018/4/11	1014.64	781.124	455.75	66.8	747.7	423.63	181.39	14.112
焦煤指数	2018/4/11	929.264	540.03	194.9	5.708	673.5	282.36	72.819	1.0326
橡胶指数	2018/4/11	956.667	195.139	8.2761	1E-04	225.4	10.937	0.1125	3E-08
螺纹指数	2018/4/11	953.384	580.678	225.13	8.415	669.8	285.24	76.566	1.3032
锌指数	2018/4/11	841.205	354.437	73.908	0.36	599.5	181.58	27.702	0.0793
铜指数	2018/4/11	1717.07	991.973	190.58	0.237	196.8	13.051	0.2887	5E-06
银指数	2018/4/11	595.277	265.605	88.322	3.88	1263	1198.5	853.1	178.01
金指数	2018/4/11	1228.39	1073.08	663.44	87.08	580.5	240.4	70.949	2.2031
燃油指数	2018/4/11	1723.9	1251.03	375.14	2.094	246.5	25.868	1.1471	0.0002
沥青指数	2018/4/11	629.58	288.605	95.51	3.738	1163	993.12	622.83	95.79
热轧卷板指数	2018/4/11	1054.24	823.984	475.38	61.33	704	367.02	140.96	7.9922
线材指数	2018/4/11	865.509	550.421	256.04	20.96	850.3	531.35	242.97	19.239
铅指数	2018/4/11	969.897	737.67	438.91	73.02	809.1	513.24	254.6	29.391
铝指数	2018/4/11	727.848	324.23	88.011	1.425	842.7	435.66	137.88	3.1082
锡指数	2018/4/11	1226.21	1344.34	1317.5	901.3	728.9	474.59	275.64	65.526

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/

免责申明

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明的日期的判断，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范式传送、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。

千际

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