CMF 招商期货

2020 年 09 月 30 日 | 星期三

招商期货商品指数高频数据日报

招商期货研究所

一、板块指数行情数据

	开盘价	最高价	最低价	收盘价	均价	波动率(%)	振幅(%)	收益风险比	上影线(%)	下影线(%)
Wind 商品指数	1122.86	1128.60	1120.70	1128.17	1123.82	0.01	0.70	0.76	5.44	27.34
Wind 贵金属	1272.01	1275.90	1264.77	1270.72	1270.00	0.01	0.88	-0.12	34.95	53.46
Wind 有色	1347.70	1349.11	1339.76	1340.95	1344.67	0.01	0.70	-0.83	15.08	12.73
Wind 煤焦钢矿	659.46	670.86	658.36	670.86	662.14	0.02	1.90	0.98	0.00	8.80
Wind 非金属建材	689.45	689.69	680.94	687.31	686.20	0.02	1.28	-0.13	2.74	72.80
Wind 能源	738.77	740.51	729.48	730.90	734.99	0.01	1.51	-1.09	15.78	12.87
Wind 化工	458.17	459.55	455.13	456.31	457.86	0.01	0.97	-0.42	31.22	26.70
Wind 谷物	505.94	510.54	504.79	510.46	506.92	0.02	1.14	0.58	1.39	20.00
Wind 油脂油料	1231.08	1239.98	1228.89	1231.04	1233.03	0.01	0.90	0.00	80.25	19.39
Wind 农副产品	864.43	885.46	864.25	885.23	871.69	0.01	2.45	2.52	1.08	0.85

数据来源：Wind

二、商品指数行情数据

	开盘价	最高价	最低价	收盘价	均价	波动率(%)	振幅(%)	收益风险比	上影线(%)	下影线(%)
连豆指数	4398.21	4398.21	4369.31	4375.67	4380.03	0.01	0.66	-0.50	0.00	22.01
沪银指数	5107.11	5107.11	5046.62	5090.12	5074.55	0.01	1.20	-0.27	0.00	71.91
沪铝指数	14152.96	14181.56	7070.72	10602.05	11241.20	29.88	100.57	-0.01	0.40	49.66
沪金指数	408.05	408.08	406.25	407.05	407.28	0.00	0.45	-0.60	1.64	43.72
胶板指数	3555.29	3556.76	3533.94	3541.37	3545.32	0.01	0.65	-0.48	6.44	32.56
沥青指数	2353.43	2362.67	2336.77	2362.57	2350.93	0.03	1.11	0.14	0.39	64.32
玉米指数	2454.95	2483.27	2454.95	2482.91	2467.41	0.01	1.15	0.91	1.27	0.00
红枣指数	1967.23	1980.86	1954.78	1979.88	1967.32	0.01	1.33	0.47	3.76	47.74
淀粉指数	2736.77	2766.04	2736.04	2766.04	2749.98	0.01	1.10	1.11	0.00	2.43
沪铜指数	51096.99	51274.43	50859.96	50931.72	51039.20	0.01	0.81	-0.55	42.81	17.31
棉纱指数	6729.51	6735.59	6691.68	6698.98	6711.56	0.01	0.66	-0.39	13.85	16.62
苯乙烯指数	3704.3	3746.48	3681.06	3732.07	3704.19	0.01	1.78	0.57	22.03	35.52
乙二醇指数	1145.01	1187.52	1132.82	1187.42	1146.58	0.04	4.83	0.87	0.18	22.29
玻璃指数	1814.03	1817.29	1803.54	1806.24	1809.60	0.02	0.76	-0.19	23.71	19.64
燃油指数	3675.36	3685.58	3662.68	3670.36	3676.07	0.01	0.63	-0.13	44.63	33.54
热卷指数	787	802.8	781.01	802.8	787.96	0.02	2.79	0.82	0.00	27.49
铁矿指数	3701.88	3776.5	3699.73	3776.45	3731.73	0.01	2.08	2.63	0.07	2.80
焦炭指数	2139.285	3010.62	1266.17	2135.45	2539.01	37.96	137.77	0.00	49.95	49.83
豆粕指数	112524.13	112852.75	111688.6	111707.04	112295.83	0.01	1.04	-1.12	28.23	1.58
沪镍指数	9530.93	9559.58	9378.12	9382.45	9468.69	0.01	1.93	-1.18	15.79	2.39
菜油指数	15047.62	15059.26	14966.03	15019.55	15020.16	0.01	0.62	-0.25	12.49	57.41
沪铅指数	5735.24	5752.35	5692.49	5710.2	5721.96	0.02	1.05	-0.28	28.58	29.59

普麦指数	7656.19	7666.46	7590.78	7616.12	7633.11	0.01	1.00	-0.51	13.57	33.48
PP指数	3541.77	3549.21	3528.18	3543.46	3539.34	0.01	0.60	0.04	27.34	64.62
菜粕指数	3466.31	3468.16	3458.07	3467.58	3462.59	0.00	0.29	0.09	5.75	81.67
菜籽指数	12593.8	12640.83	12372.13	12372.13	12525.88	0.01	2.17	-1.27	17.50	0.00
沪胶指数	271.74	271.86	268.82	269.59	270.20	0.01	1.13	-0.65	3.95	25.33
硅铁指数	144622.2	145629.72	144563.52	145465.76	145156.77	0.01	0.74	0.68	15.38	5.50
锰硅指数	4580.51	4608.13	4575.13	4597.3	4595.16	0.01	0.72	0.31	32.82	16.30
不锈钢指数	6570.3	6594.26	6539.41	6554.01	6565.83	0.03	0.84	-0.10	43.68	26.62
尿素指数	3858.76	3858.76	3848.23	3848.23	3856.47	0.00	0.27	-0.88	0.00	0.00
线材指数	19275.93	19301.14	19132.35	19192.88	19224.83	0.01	0.88	-0.62	14.94	35.86
豆油指数	5609.06	5618.93	5534.21	5588.8	5579.59	0.01	1.53	-0.30	11.65	64.44

数据来源:Wind

三、商品ETF行情数据

	开盘价	最高价	最低价	收盘价	均价	波动率(%)	振幅(%)	收益风险比	上影线(%)	下影线(%)
有色期货	1.05	1.05	1.05	1.05	1.05	0.04	0.57	-0.01	66.67	29.17
豆粕ETF	1.07	1.08	1.07	1.07	1.08	0.09	1.03	0.02	86.36	0.00
能源化工	0.86	0.86	0.85	0.86	0.85	0.08	1.41	-0.02	0.00	87.50

数据来源:Wind

四、板块相关性分析

Wind版块名称	商品指数	贵金属	有色	煤焦钢矿	非金属建材	能源	化工	谷物	油脂油料	农副产品
商品指数	1	0.44	0.18	0.8	0.64	0.04	0.49	0.16	0.13	0.4
贵金属	0.44	1	0.79	-0.14	0.83	0.79	0.82	-0.72	0.13	-0.58
有色	0.18	0.79	1	-0.31	0.68	0.77	0.84	-0.7	-0.04	-0.72
煤焦钢矿	0.8	-0.14	-0.31	1	0.16	-0.49	-0.06	0.65	-0.11	0.81
非金属建材	0.64	0.83	0.68	0.16	1	0.57	0.83	-0.51	0.05	-0.34
能源	0.04	0.79	0.77	-0.49	0.57	1	0.69	-0.88	0.29	-0.83
化工	0.49	0.82	0.84	-0.06	0.83	0.69	1	-0.63	0.2	-0.5
谷物	0.16	-0.72	-0.7	0.65	-0.51	-0.88	-0.63	1	-0.2	0.9
油脂油料	0.13	0.13	-0.04	-0.11	0.05	0.29	0.2	-0.2	1	-0.08
农副产品	0.4	-0.58	-0.72	0.81	-0.34	-0.83	-0.5	0.9	-0.08	1

数据来源:招商期货、Wind

招商期货量化研究小组

林立东

电话：0755-82763489

linld@cmschina.com.cn

Z0011354

公众微信报名：招商期货研究所



重要声明

《证券期货投资者适当性管理办法》于 2017 年 7 月 1 日起正式实施，本报告发布的观点和信息仅供经招商期货有限公司评估风险承受能力为 C3 及 C3 以上类别的投资者参考。若您的风险承受能力不满足上述条件，请取消订阅、接收或使用本研报中的任何信息。请您审慎考察金融产品或服务的风险及特征，根据自身的风险承受能力自行作出投资决定并自主承担投资风险。

本报告基于合法取得的信息，但招商期货对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。本报告所包含的分析基于各种假设，不同假设可能导致分析结果出现重大不同。报告中的内容和意见仅供参考，并不构成对所述品种买卖的出价或对任何人的投资建议，招商期货不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。投资者据此作出的任何投资决策与本公司、本公司员工无关。

市场有风险，投资需谨慎。投资者不应将本报告作为投资决策的唯一参考因素，亦不应认为本报告可取代自己的判断。除法律或规则规定必须承担的责任外，招商期货及其员工不对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失负任何责任。

本报告版权归招商期货所有，未经招商期货事先书面许可，任何机构和个人均不得以任何形式翻版、复制、引用或转载。