

## 相关系数表

\*以下相关系数的计算依据彭博提供的日收盘价，日期为 2016/2/16 至 2017/2/14 (约 1 年)

\*相关系数表对套利、对冲等交易提供了有价值的相关信息，其中背景色红色为大于 0.8 的值，背景色绿色为小于 -0.8 的值

2016/2/16 2017/2/14	美黄金GC连续	美白银SI连续	美原油CL连续	布油COIL连续	天然气NG连续	玉米ZC连续	美豆ZS连续	美麦ZW连续	美豆油ZL连续	英镑6B连续	欧元6B连续	美元指数DX连续	澳元6A连续	日元6J连续	纽元6N连续	加元6C连续	瑞郎6S连续	小标普ES连续	小道指YM连续	富时A50 CN连续	国企指数HHI连续	恒指HIS连续	JPX日元日经JNK连续	CMB日元日经CNK连续	CMB美元日经CNU连续	新加坡日元日经NK连续
美黄金GC连续	1.0000																									
美白银SI连续	0.7896	1.0000																								
美原油CL连续	-0.2276	0.2279	1.0000																							
布油COIL连续	-0.2643	0.2166	0.9895	1.0000																						
天然气NG连续	-0.1855	0.3667	0.7739	0.8056	1.0000																					
玉米ZC连续	-0.2710	-0.4349	0.1070	0.0587	-0.3345	1.0000																				
美豆ZS连续	-0.0344	0.2365	0.7126	0.6646	0.3952	0.5554	1.0000																			
美麦ZW连续	-0.0842	-0.4622	-0.3012	-0.3333	-0.7003	0.8313	0.1872	1.0000																		
美豆油ZL连续	-0.6087	-0.2358	0.5138	0.5530	0.5658	-0.0988	0.1676	-0.3013	1.0000																	
英镑6B连续	0.1257	-0.3409	-0.5351	-0.5725	-0.8357	0.5906	-0.0587	0.8145	-0.5331	1.0000																
欧元6B连续	0.6366	0.1893	-0.4359	-0.4882	-0.6315	0.2038	-0.1102	0.4616	-0.5311	0.7034	1.0000															
美元指数DX连续	-0.6663	-0.2218	0.4232	0.4775	0.6414	-0.2437	0.0535	-0.4928	0.5880	-0.7376	-0.9892	1.0000														
澳元6A连续	0.4102	0.4823	0.1056	0.1175	0.1415	-0.3440	-0.0906	-0.2057	0.2165	-0.2584	0.2450	-0.2134	1.0000													
日元6J连续	0.8963	0.7772	-0.0240	-0.0728	0.0317	-0.2916	0.0604	-0.2305	-0.3857	-0.0478	0.5887	-0.6000	0.4487	1.0000												
纽元6N连续	0.3892	0.7451	0.5324	0.5483	0.6924	-0.4418	0.2912	-0.6150	0.2800	-0.6408	-0.1316	0.1273	0.6279	0.5350	1.0000											
加元6C连续	0.3902	0.3149	0.2258	0.1994	-0.1536	0.3547	0.4247	0.4230	-0.1293	0.4225	0.5841	-0.6231	0.4211	0.3480	0.1820	1.0000										
瑞郎6S连续	0.6854	0.3010	-0.3426	-0.3864	-0.4793	0.1393	-0.0617	0.3710	-0.4299	0.5298	0.9257	-0.9102	0.4304	0.6635	0.0765	0.6171	1.0000									
小标普ES连续	-0.2050	0.3622	0.7789	0.8207	0.8362	-0.3017	0.3890	-0.5616	0.5631	-0.7425	-0.6159	0.6105	0.3090	-0.0928	0.6742	0.0399	-0.4524	1.0000								
小道指YM连续	-0.3621	0.2117	0.7589	0.8086	0.8116	-0.2344	0.3827	-0.4984	0.6305	-0.7187	-0.7107	0.7076	0.2133	-0.2686	0.5607	-0.0261	-0.5513	0.9791	1.0000							
富时A50 CN连续	-0.4209	0.0796	0.6204	0.6649	0.7059	-0.2985	0.2179	-0.5071	0.8009	-0.7191	-0.6584	0.6812	0.3462	-0.2815	0.5403	-0.1258	-0.5146	0.8413	0.8715	1.0000						
国企指数HHI连续	-0.0782	0.3711	0.5812	0.6248	0.7421	-0.5255	0.0618	-0.6848	0.6556	-0.7889	-0.4377	0.4723	0.5811	0.1023	0.7604	-0.0441	-0.2791	0.8168	0.7616	0.8450	1.0000					
恒指HIS连续	0.0928	0.5147	0.5723	0.6032	0.7421	-0.5609	0.0728	-0.7318	0.5049	-0.7902	-0.3410	0.3700	0.5914	0.2821	0.8287	-0.0264	-0.1874	0.7799	0.6866	0.7290	0.9687	1.0000				
JPX日元日经JNK连续	-0.6909	-0.2141	0.5881	0.6471	0.6095	-0.1119	0.1690	-0.3416	0.7080	-0.5882	-0.8222	0.8378	-0.0025	-0.6387	0.1999	-0.2656	-0.7597	0.7643	0.8476	0.8126	0.6226	0.4948	1.0000			
CMB日元日经CNK连续	-0.7002	-0.2145	0.5947	0.6527	0.6122	-0.1086	0.1808	-0.3417	0.7140	-0.5925	-0.8342	0.8479	0.0034	-0.6466	0.2071	-0.2617	-0.7713	0.7710	0.8556	0.8180	0.6188	0.4894	0.9915	1.0000		
CMB美元日经CNU连续	-0.6992	-0.2128	0.5979	0.6559	0.6150	-0.1035	0.1854	-0.3382	0.7125	-0.5906	-0.8334	0.8470	0.0053	-0.6471	0.2088	-0.2554	-0.7678	0.7722	0.8571	0.8154	0.6175	0.4881	0.9912	0.9997	1.0000	
新加坡日元日经NK连续	-0.6914	-0.2131	0.5902	0.6491	0.6112	-0.1108	0.1726	-0.3412	0.7078	-0.5888	-0.8244	0.8395	-0.0035	-0.6393	0.2016	-0.2661	-0.7616	0.7655	0.8491	0.8134	0.6219	0.4943	0.9997	0.9922	0.9920	1.0000

\*以下相关系数的计算依据彭博提供的日收盘价，日期为 2013/5/2 至 2017/2/14 (约 3.76 年)

\*相关系数表对套利、对冲等交易提供了有价值的相关信息，其中背景色红色为大于 0.8 的值，背景色绿色为小于 -0.8 的值

2013/5/2-2017/2/14	美黄金GC连续	美白银SI连续	美原油CL连续	布油COIL连续	天然气NG连续	玉米ZC连续	美豆ZS连续	美麦ZW连续	美豆油ZL连续	英镑6B连续	欧元6B连续	美元指数DX连续	澳元6A连续	日元6J连续	纽元6N连续	加元6C连续	瑞郎6S连续	小标普ES连续	小道指YM连续	富时A50 CN连续	国企指数HHI连续	恒指HIS连续	JPX日元日经JNK连续	CMB日元日经CNK连续	CMB美元日经CNU连续	新加坡日元日经NK连续
美黄金GC连续	1.0000																									
美白银SI连续	0.8962	1.0000																								
美原油CL连续	0.5688	0.7877	1.0000																							
布油COIL连续	0.5506	0.7825	0.9952	1.0000																						
天然气NG连续	0.4472	0.6573	0.8574	0.8607	1.0000																					
玉米ZC连续	0.4754	0.5874	0.6653	0.6671	0.5328	1.0000																				
美豆ZS连续	0.6415	0.7905	0.8228	0.8271	0.7593	0.8363	1.0000																			
美麦ZW连续	0.4111	0.5972	0.8088	0.8208	0.6337	0.8635	0.8153	1.0000																		
美豆油ZL连续	0.6657	0.8010	0.8019	0.7952	0.6619	0.8288	0.8874	0.7585	1.0000																	
英镑6B连续	0.1065	0.3072	0.6889	0.7094	0.5595	0.4669	0.4596	0.7331	0.3143	1.0000																
欧元6B连续	0.5724	0.7546	0.9459	0.9469	0.8273	0.6482	0.8111	0.8329	0.7381	0.7576	1.0000															
美元指数DX连续	-0.5964	-0.7661	-0.9456	-0.9465	-0.8007	-0.6568	-0.8009	-0.8389	-0.7355	-0.7699	-0.9957	1.0000														
澳元6A连续	0.6432	0.8135	0.9521	0.9540	0.8189	0.6802	0.8061	0.8192	0.8115	0.6630	0.9374	-0.9442	1.0000													
日元6J连续	0.8491	0.8765	0.7055	0.6852	0.5553	0.4926	0.7170	0.4780	0.7441	0.1752	0.7183	-0.7261	0.7233	1.0000												
纽元6N连续	0.6301	0.7837	0.9036	0.9092	0.8595	0.5430	0.7770	0.7060	0.7102	0.6233	0.8980	-0.8924	0.9387	0.6886	1.0000											
加元6C连续	0.5974	0.7876	0.9554	0.9588	0.7767	0.7040	0.7923	0.8609	0.8011	0.6934	0.9271	-0.9420	0.9697	0.6772	0.8840	1.0000										
瑞郎6S连续	0.5001	0.6253	0.7760	0.7893	0.6880	0.4880	0.6621	0.6894	0.5400	0.7580	0.8287	-0.8319	0.7542	0.5226	0.7816	0.7353	1.0000									
小标普ES连续	-0.4426	-0.6025	-0.7288	-0.7302	-0.4704	-0.7731	-0.6821	-0.8400	-0.7243	-0.5982	-0.7697	0.7855	-0.7289	-0.5865	-0.5497	-0.7841	-0.5502	1.0000								
小道指YM连续	-0.3777	-0.5175	-0.6555	-0.6578	-0.3949	-0.6861	-0.5790	-0.7848	-0.5891	-0.6468	-0.7336	0.7530	-0.6553	-0.5233	-0.4772	-0.7065	-0.5489	0.9745	1.0000							
富时A50 CN连续	-0.5124	-0.6269	-0.7456	-0.7282	-0.6670	-0.4987	-0.6572	-0.5682	-0.5977	-0.4654	-0.8238	0.8070	-0.7241	-0.7609	-0.6719	-0.6797	-0.5248	0.6629	0.6400	1.0000						
国企指数HHI连续	-0.1507	-0.0346	0.1198	0.1596	0.1201	-0.0247	-0.0588	0.1634	-0.0623	0.3362	0.0079	-0.0325	0.1450	-0.3579	0.1921	0.1995	0.2471	0.0911	0.1019	0.4927	1.0000					
恒指HIS连续	-0.0924	0.0111	0.1203	0.1514	0.1698	-0.1668	-0.0963	0.0153	-0.1005	0.2298	-0.0135	-0.0052	0.1347	-0.2736	0.2180	0.1474	0.2397	0.2488	0.2578	0.4534	0.9396	1.0000				
JPX日元日经JNK连续	-0.7632	-0.7764	-0.7272	-0.7049	-0.5663	-0.5891	-0.7254	-0.6176	-0.7171	-0.3630	-0.8053	0.8116	-0.7610	-0.9018	-0.6948	-0.7293	-0.5555	0.7505	0.7111	0.8669	0.4143	0.4242	1.0000			
CMB日元日经CNK连续	-0.7636	-0.7757	-0.7257	-0.7034	-0.5653	-0.5877	-0.7238	-0.6176	-0.7156	-0.3654	-0.8067	0.8130	-0.7591	-0.9023	-0.6935	-0.7278	-0.5580	0.7547	0.7167	0.8671	0.4154	0.4257	0.9972	1.0000		
CMB美元日经CNU连续	-0.7644	-0.7770	-0.7275	-0.7055	-0.5673	-0.5862	-0.7246	-0.6174	-0.7156	-0.3677	-0.8082	0.8144	-0.7610	-0.9026	-0.6961	-0.7286	-0.5600	0.7540	0.7164	0.8681	0.4135	0.4226	0.9970	0.9999	1.0000	
新加坡日元日经NK连续	-0.7638	-0.7770	-0.7275	-0.7053	-0.5667	-0.5894	-0.7257	-0.6179	-0.7178	-0.3630	-0.8057	0.8120	-0.7617	-0.9022	-0.6955	-0.7299	-0.5555	0.7505	0.7109	0.8671	0.4139	0.4237	0.9999	0.9972	0.9971	1.0000