入选资产：

美国债券（巴克莱美国综合债券指数）

美国国债（巴克莱美国国债指数）

美国公司债（巴克莱美国公司债指数）

美国高收益债（巴克莱美国高收益债指数）

美国股票（标普500指数）

美国房地产（MSCI美国REITs指数）

全球股市（MSCI世界指数）

新兴市场国家股市（MSCI新兴国家指数）

全球房地产（富时全球REITs指数）

商品（彭博全球商品指数）

黄金（伦敦现货黄金价格）

数据长度：

|  |  |
| --- | --- |
| 美国债券（巴克莱美国综合债券指数） | 1976.1 |
| 美国国债（巴克莱美国国债指数） | 1973.1 |
| 美国公司债（巴克莱美国公司债指数） | 1973.1 |
| 美国高收益债（巴克莱美国高收益债指数） | 1983.7 |
| 美国股票（标普500指数） | 1928.1 |
| 美国房地产（MSCI美国REITs指数） | 2005.6 |
| 全球股市（MSCI世界指数） | 1970.1 |
| 新兴市场国家股市（MSCI新兴国家指数） | 1988.1 |
| 全球房地产（富时全球REITs指数） | 2005.2 |
| 商品（彭博全球商品指数） | 1991.3 |
| 黄金（伦敦现货黄金价格） | 1971.1 |

计算24个月的滑动月度相关系数：