

一. 商品指数走势

文华商品指数与波动率对比



中融汇信研究院
中融汇信量化研究小组
研究员：王禄利
从业资格号：F3051454

二. 商品持仓变动：

	日涨跌	日持仓变动
沥青	1.26%	-13.03%
PP	-1.44%	-6.51%
热卷	0.20%	-5.35%
甲醇	0.32%	-5.31%
焦煤	-0.52%	-4.97%
棕榈	0.49%	-4.10%
沪镍	0.74%	-4.00%
沪锌	-0.10%	-3.99%
豆油	0.26%	-2.81%
锰硅	-0.98%	-2.10%
沪银	-0.39%	-1.66%
玉米	-0.05%	-1.50%
棉花	0.60%	-1.17%
动煤	-0.46%	-1.10%
豆粕	-0.48%	-1.08%
PTA	-0.84%	-0.97%
白糖	-0.06%	-0.74%
苹果	0.21%	-0.50%
沪铜	0.27%	-0.48%
橡胶	1.64%	1.13%
沪铝	0.15%	2.27%
沪铅	-0.22%	2.35%
沪金	-0.14%	3.29%
原油	0.68%	3.48%
焦炭	-0.07%	4.95%
燃油	-0.36%	6.43%
螺纹	1.40%	7.13%
铁矿	1.72%	8.38%

微信公众号：



联系方式：021-51557562
网址：<http://zrhxqh.com/>
地址：上海市浦东新区源深路 1088 号
平安财富大厦 25 楼

三. 商品择时建议:

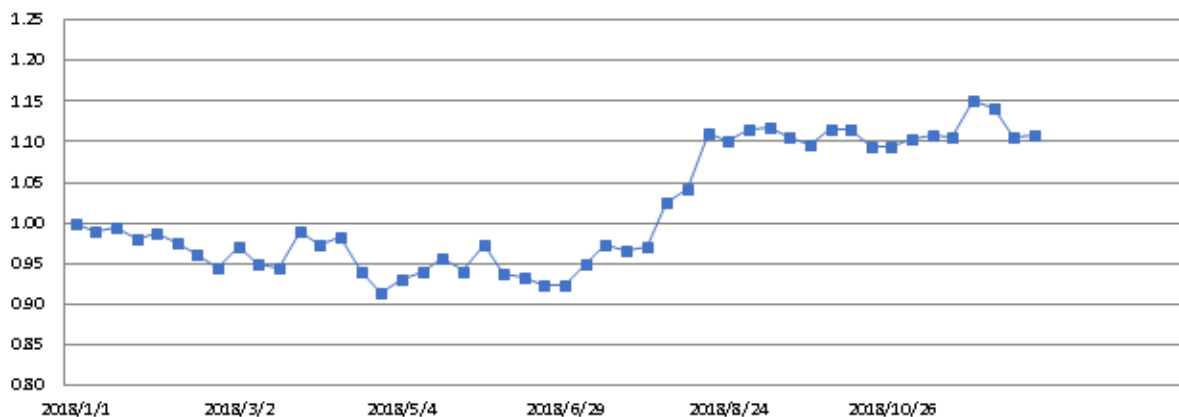
中线		中线	
玉米	建议持空	铜	建议持空
豆油	建议持空	铝	建议持空
豆粕	建议持空	锌	建议观望
白糖	建议持多	镍	建议持空
棉花	建议观望	白银	建议持多
焦炭	建议观望	橡胶	建议持多
动煤	建议持空	PTA	建议观望
螺纹	建议持空	PP	建议观望
铁矿	建议观望	沥青	建议持空
锰硅	建议持空	甲醇	建议观望
5 年期债	建议持空		
10 年期债	建议持空		
IF	建议持空		
IH	建议持空		
IC	建议持空		

四、每周模拟盘展示 (第一期):

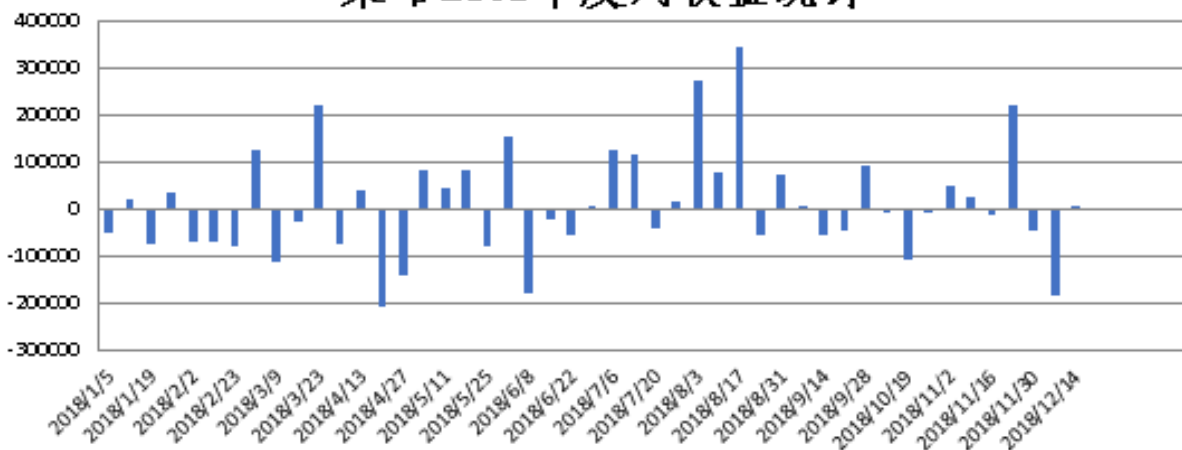
品种	买卖手数	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
锰硅 1905	-25	7458	7382		9880	
沥青 1906	-28	2778	2726		14560	
豆粕 1905	-123	2665	2663		860	
沪镍 1905	-9	89050	90080		-9270	
螺纹 1905	-26	3448	3481		-8580	
累计盈亏					7450	
收益率					0.15%	

说明: 模拟盘初始资金 500 万, 每周选取 5 个市场热点品种, 按照量化择时策略进行多空配置。
 模拟盘平均开仓比例约为 15%, 历史平均年化收益 23.7%, 最大回撤 12%。
 选品种详细参阅量化择时周报, 每周商品热点跟踪。

模拟盘策略2018年表现



策略2018年度周收益统计



免责声明:

本报告所载的内容仅作参考之用，不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。此报告的内容不构成对任何人的投资建议，而中融汇信不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。本报告中的信息均来源于公开可获得资料，中融汇信力求准确可靠，但对信息的准确性及完整性不做任何保证。客户应谨慎考虑本报告中的任何意见和建议，不能依赖此报告以取代自己的独立判断，而中融汇信不对因使用此报告而引起的损失负任何责任。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中融汇信期货有限公司的立场。中融汇信可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。未经中融汇信授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。