

一. 商品指数走势:

文华商品指数走势与波动率对比



中融汇信研究院

中融汇信量化研究小组

二. 商品持仓变动:

研究员: 徐坚

从业资格号: F3052114

投询资格号: Z0013802

微信公众号:



联系方式: 021-51557572

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

	日涨跌	日持仓变动
焦炭	0.59%	-8.82%
甲醇	1.44%	-5.30%
动煤	-0.41%	-4.16%
橡胶	-1.07%	-3.30%
铁矿	-0.74%	-3.10%
螺纹	0.95%	-2.65%
原油	0.35%	-2.26%
沪银	-0.61%	-2.04%
PTA	0.44%	-1.26%
白糖	0.51%	-0.93%
PP	-0.25%	-0.48%
燃油	1.11%	-0.30%
豆油	-0.31%	0.07%
锰硅	0.82%	0.21%
沪镍	0.27%	0.30%
苹果	0.23%	0.46%
沪铜	-0.06%	0.86%
焦煤	1.60%	0.89%
沪铝	0.26%	0.93%
沪金	-0.63%	1.42%
玉米	0.11%	1.58%
豆粕	0.12%	1.72%
棕榈	-0.55%	2.14%
热卷	0.39%	2.42%
沪锌	-0.86%	3.38%
棉花	-0.48%	3.98%
沪铅	-0.15%	5.45%
沥青	2.44%	5.99%

三、商品操作建议：

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

说明：带“*”标注为当日操作变化

四、每周模拟盘展示（第十五期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
PTA1905						
铁矿 1905	19	628	615		-24700	
沪镍 1905	12	97100	100980		46560	
沥青 1906	23	3160	3280		27600	
动煤 1905	30	590	585.6		-13200	
累计盈亏					36260	
收益率					0.73%	

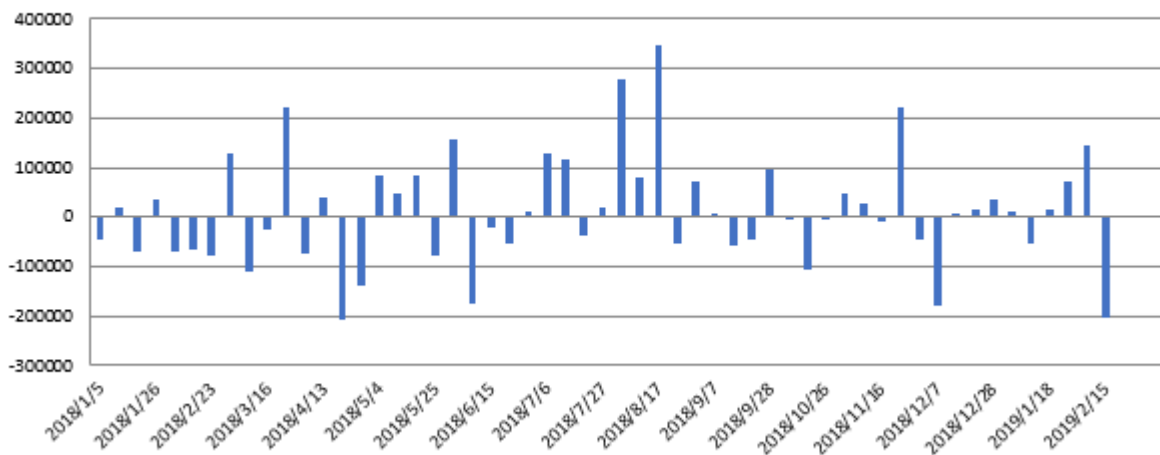
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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%。

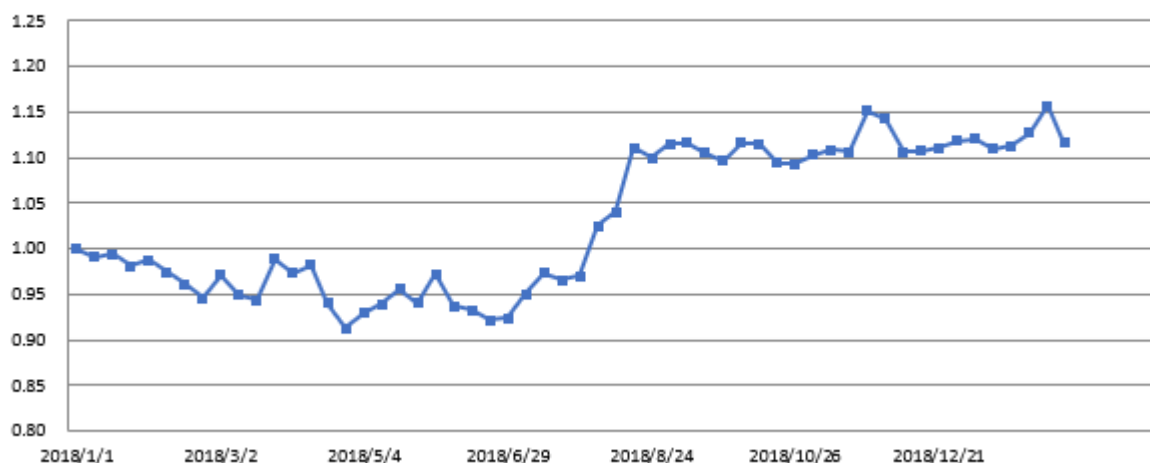
选品种详细参阅量化择时周报，每周商品热点跟踪。

（选品种策略本周改版中，暂时按照旧策略统计收益）

选品种策略周收益统计



选品种策略周净值走势



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。