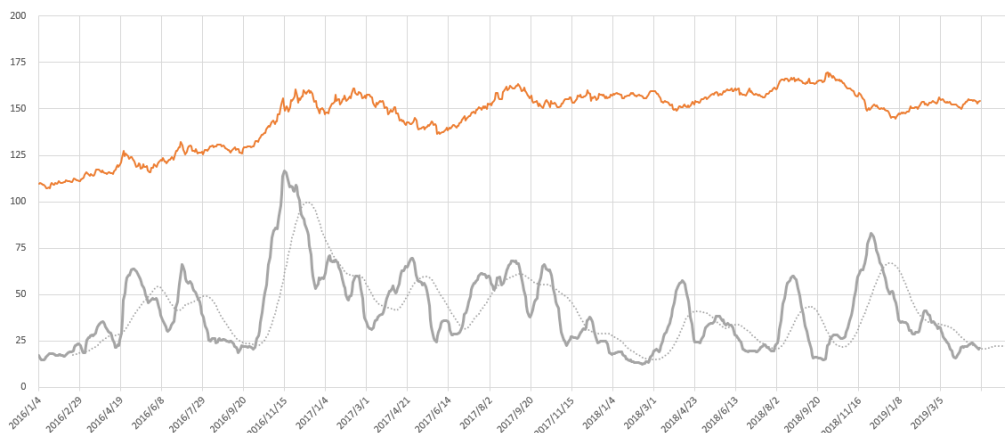


## 一. 商品指数走势:

文华商品指数走势与波动率对比



中融汇信投资研究中心

中融汇信量化研究

研究员: 徐坚

从业资格号: F3052114

投询资格号: Z0013802

## 二. 商品持仓变动:

	日涨跌		日持仓变动
沪铅	0.42%	■	-5.33%
棕榈	0.13%	■	-5.33%
沪金	0.30%	■	-3.13%
铁矿	0.71%	■	-2.74%
螺纹	0.66%	■	-2.65%
白糖	0.33%	■	-2.57%
热卷	0.51%	■	-2.55%
豆油	0.11%	■	-2.47%
动煤	0.91%	■	-1.85%
豆粕	0.08%	■	-1.46%
橡胶	0.22%	■	-1.40%
沪铜	-0.55%	■	-1.13%
焦煤	-0.15%	■	-1.07%
沪银	0.48%	■	-0.48%
燃油	1.50%	■	-0.09%
棉花	0.28%	■	0.16%
PTA	0.87%	■	0.19%
焦炭	-0.66%	■	0.50%
沪镍	-0.59%	■	0.77%
PP	-0.12%	■	1.08%
沪锌	0.02%	■	1.71%
玉米	0.79%	■	2.47%
苹果	0.26%	■	2.78%
原油	2.80%	■	3.63%
沪铝	0.78%	■	3.88%
甲醇	0.78%	■	7.41%
锰硅	-0.60%	■	8.09%
沥青	2.19%	■	16.56%

微信公众号:



联系方式: 021-51557572

网址: <http://zrhxqh.com/>

地址: 上海市自由贸易试验区

东育路 255 弄 5 号 29 层

### 三、商品操作建议：

持仓周期（中线）		持仓周期（中线）	
玉米	建议持多	铜	建议持多
棕油	建议观望	铝	建议持多
豆粕	建议持多	锌	建议持空
白糖	建议持多	镍	建议持空
棉花	建议持多	白银	建议持空
焦炭	建议观望	橡胶	建议观望
动煤	建议观望	PTA	建议持空
螺纹	建议持多	PP	建议观望
铁矿	建议观望	沥青	建议持多 *
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	建议观望		
IH	建议持多		
IC	建议持空		

说明：带“\*”标注为当日操作变化，2019/3/21日品种调整，调出‘豆油’，新增‘棕榈油’。

### 四、每周模拟盘展示（第24期）：

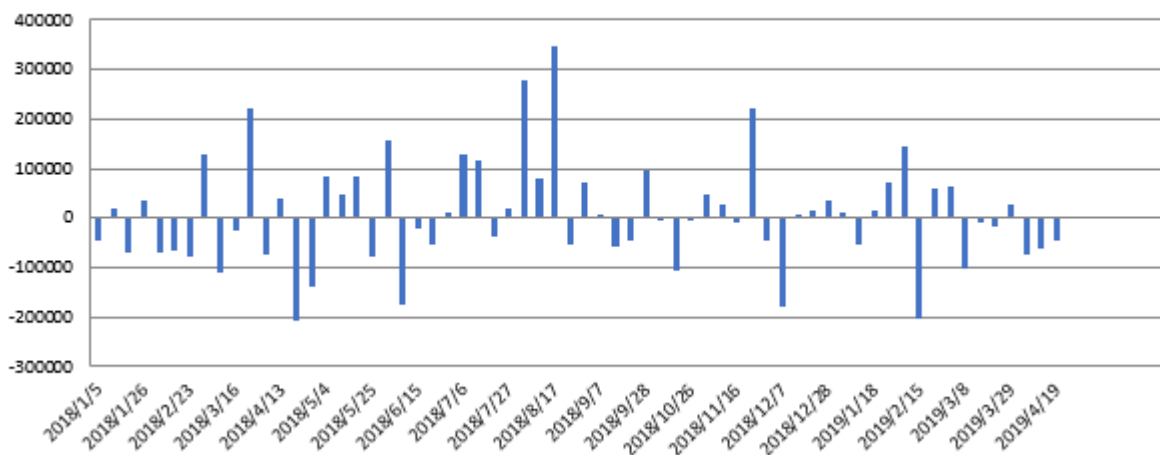
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
橡胶 1909						
白糖 1909	41	5350	5360		4100	
锰硅 1905	-45	7460	7390		15750	
铁矿 1909						
焦炭 1909						
累计盈亏					19850	
收益率					0.40%	

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。模拟盘组合按照总资金2%止损。

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。