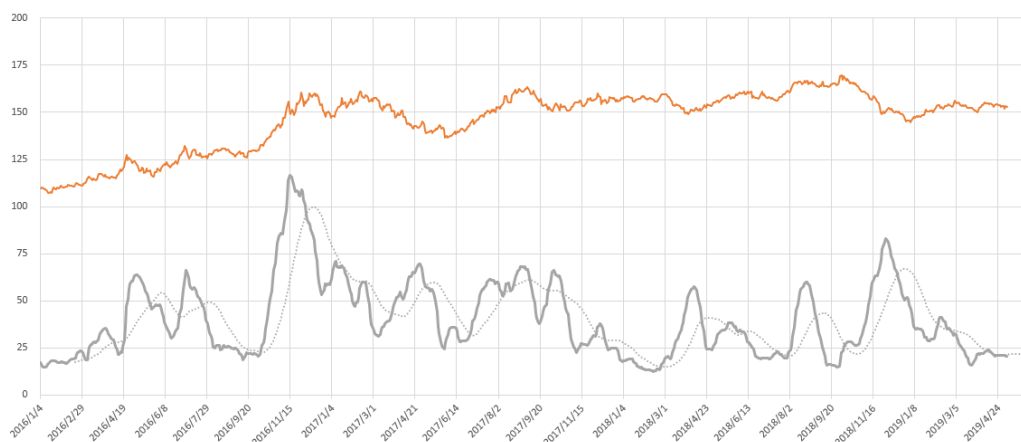


一. 商品指数走势:

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

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: 上海市自由贸易试验区

东育路 255 弄 5 号 29 层

	日涨跌	日持仓变动
焦煤	-0.33%	-8.56%
沥青	-1.01%	-5.82%
铁矿	-1.07%	-4.68%
甲醇	0.61%	-4.40%
豆油	-0.22%	-2.33%
橡胶	-0.13%	-1.21%
燃油	-1.19%	-0.62%
热卷	-1.16%	-0.27%
玉米	-0.31%	-0.21%
沪镍	-0.09%	0.23%
苹果	1.31%	0.23%
锰硅	0.62%	0.25%
动煤	-0.79%	0.34%
棉花	-0.80%	0.37%
白糖	-0.43%	1.39%
豆粕	0.31%	1.75%
棕榈	-0.27%	1.82%
原油	-0.54%	1.83%
沪铝	0.18%	2.11%
沪银	0.34%	2.54%
PTA	-0.24%	2.65%
沪铜	-0.85%	2.91%
沪金	0.55%	3.15%
沪锌	-1.84%	3.71%
焦炭	1.35%	4.39%
沪铅	-0.06%	5.08%
螺纹	-0.96%	5.29%
PP	-1.66%	5.45%

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	建议持空
棕油	建议持空	铝	建议观望
豆粕	建议观望	锌	建议持空
白糖	建议观望	镍	建议持空
棉花	建议持空	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议观望
动煤	建议观望	PTA	建议持空
螺纹	建议观望	PP	建议持空 *
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	建议持空		
IH	建议持空		
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26期):

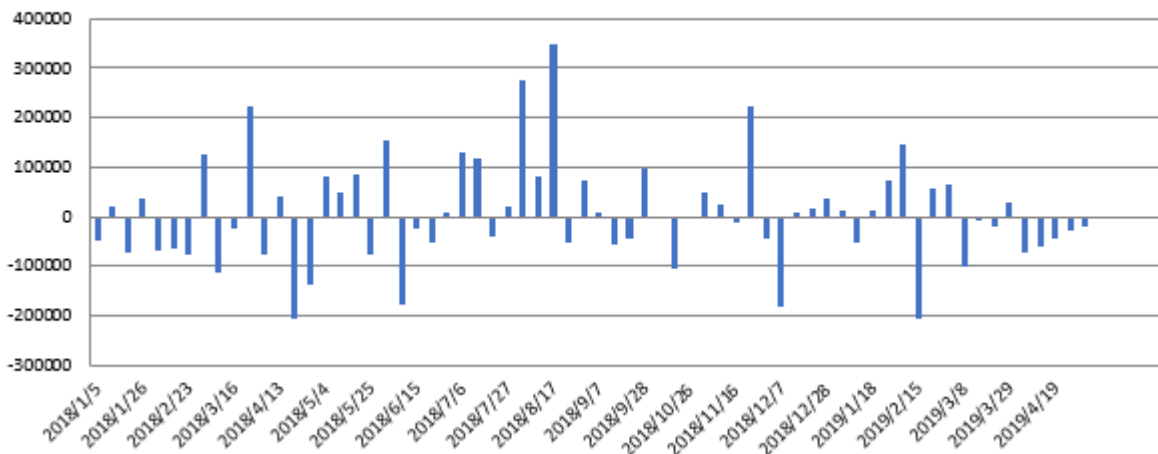
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
沪锌 1906	-11	21525	21210		17325	
沥青 1912	32	3534	3522		-3840	
螺纹 1910						
沪镍 1907	-11	95760	96180		-4620	
锰硅 1909	-45	7270	7124		32850	
累计盈亏					41715	
收益率					0.83%	

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。