

一. 商品指数走势

文华商品指数与波动率对比



二. 商品持仓变动:

	日涨跌	日持仓变动
螺纹	-1.59%	-4.63%
热卷	-1.54%	-4.25%
沪锌	-0.19%	-3.97%
棕榈	-1.55%	-3.21%
苹果	0.46%	-2.69%
豆粕	0.19%	-2.60%
玉米	0.87%	-2.43%
铁矿	-1.01%	-2.18%
沪镍	-1.53%	-2.17%
豆油	-1.03%	-1.78%
PTA	-2.76%	-1.66%
锰硅	-0.58%	-1.54%
棉花	-2.23%	-0.95%
沪铝	0.29%	-0.70%
沪银	0.03%	-0.30%
甲醇	-3.98%	-0.25%
白糖	-0.60%	0.78%
沪铅	-0.58%	0.94%
沪铜	-0.21%	1.36%
沪金	0.58%	1.80%
橡胶	-2.51%	2.12%
焦煤	-2.54%	2.75%
原油	-7.26%	2.98%
沥青	-5.36%	4.38%
动煤	-1.65%	5.56%
PP	-1.01%	8.04%
燃油	-6.02%	10.52%
焦炭	-4.99%	15.22%

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

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. 商品操作建议:

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

四、每周模拟盘展示 (第八期):

品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
锰硅 1905	-26	7236	7244		-1040	
沥青 1906	-28	2730	2580		42000	
豆粕 1905	-43	2661	2631		12900	
沪铜 1902	-7	48300	48010		10150	
铁矿石 1905	19	497	486		-20900	
累计盈亏					43110	
收益率					0.86%	

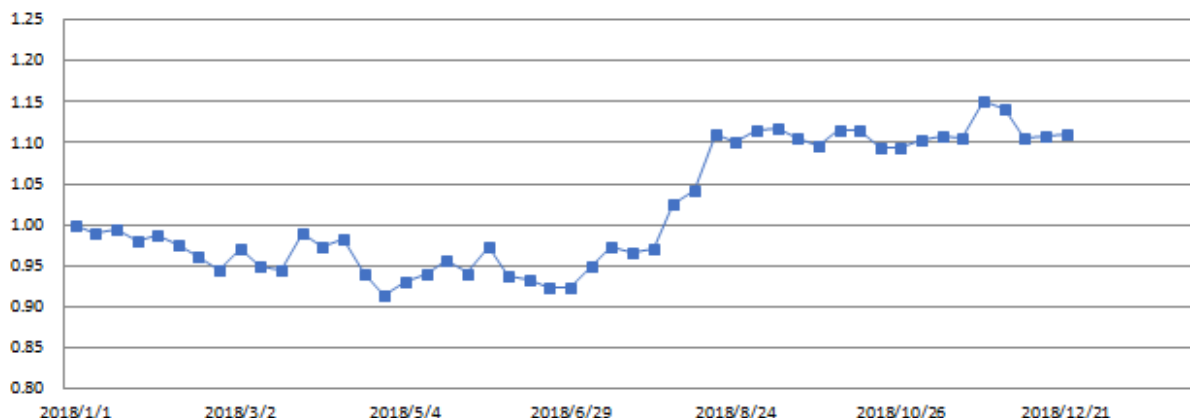
说明: 模拟盘初始资金 500 万, 每周选取 5

个市场热点品种, 按照量化择时策略进行多空配置。

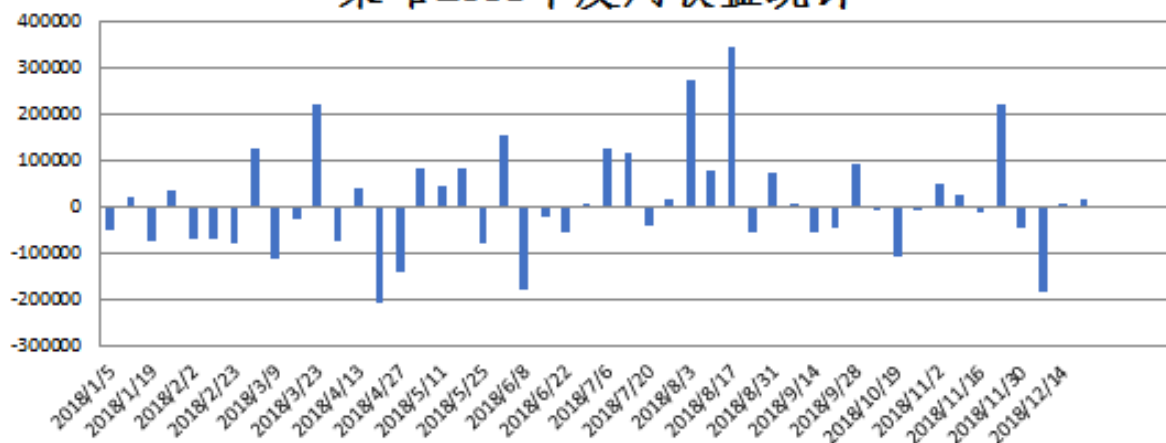
模拟盘平均开仓比例约为 15%, 历史平均年化收益 23.7%, 最大回撤 12%。

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。