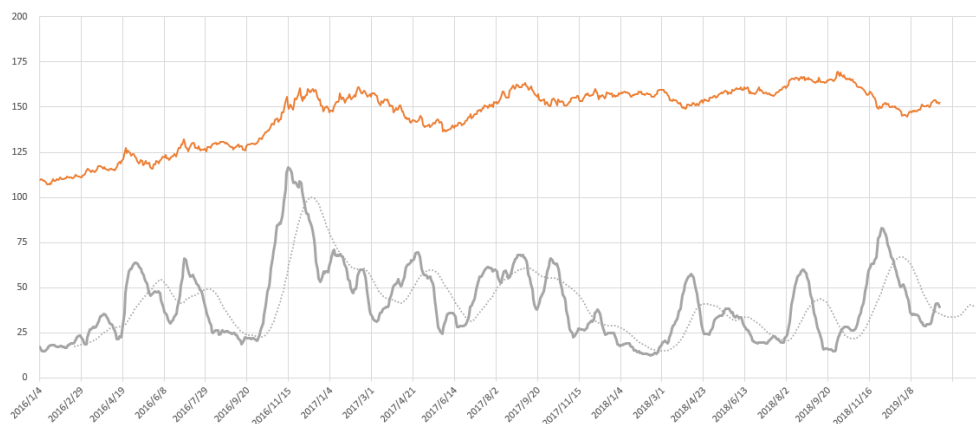


## 一. 商品指数走势:

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

	日涨跌	日持仓变动
燃油	1.49%	20.01%
沪铅	0.62%	-7.28%
原油	2.50%	-6.23%
PTA	1.42%	-4.28%
热卷	2.43%	-3.98%
螺纹	1.58%	-3.18%
沪铝	0.52%	-2.91%
棉花	0.36%	-2.38%
沥青	1.97%	-2.11%
锰硅	-0.97%	-1.86%
苹果	-0.27%	-0.41%
白糖	1.71%	0.41%
沪镍	1.75%	0.50%
玉米	-1.03%	0.71%
豆粕	-0.19%	1.42%
焦煤	-1.01%	1.65%
沪锌	0.83%	2.15%
沪铜	2.06%	2.15%
PP	0.39%	2.31%
铁矿	0.73%	2.31%
豆油	0.95%	2.50%
沪银	0.97%	2.51%
橡胶	1.53%	2.58%
动煤	-0.71%	2.72%
沪金	0.48%	4.32%
甲醇	-1.25%	5.00%
焦炭	1.28%	6.77%
棕榈	0.21%	11.25%

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

### 三、商品操作建议：

持仓周期（中线）		持仓周期（中线）	
玉米	建议观望	铜	建议持多
豆油	建议持多	铝	建议观望
豆粕	建议观望	锌	建议观望
白糖	建议观望	镍	建议持多
棉花	建议观望	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议观望
动煤	建议持多	PTA	建议观望
螺纹	建议观望	PP	建议持空 *
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	建议持多		
10年期债	建议持多		
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	628		0	
沪镍 1905	12	97100	98390		15480	
沥青 1906	23	3160	3212		11960	
动煤 1905	30	590	583.8		-18600	
累计盈亏					8840	
收益率					0.18%	

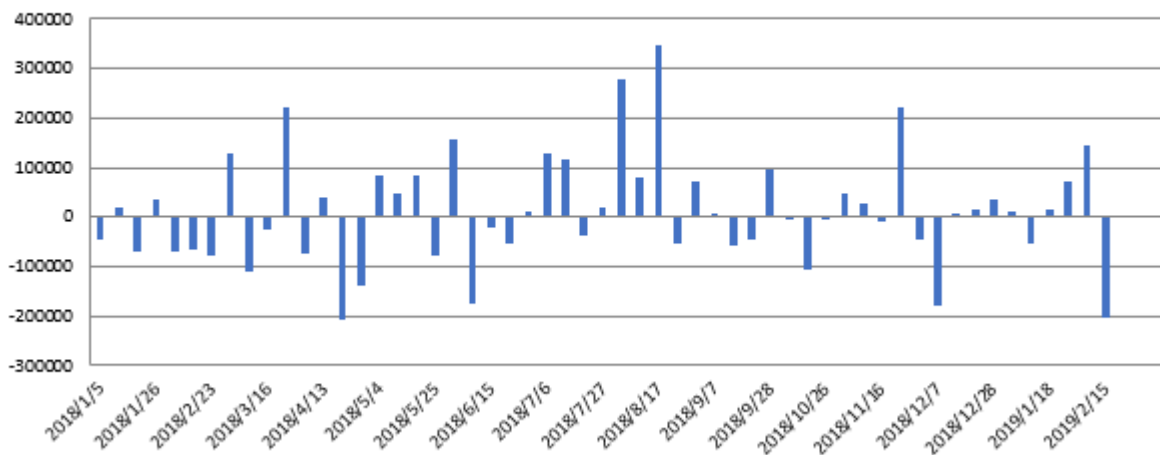
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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。