

## 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

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

## 二. 商品持仓变动:

	日涨跌	日持仓变动
白糖	-0.46%	-3.22%
沪镍	0.09%	-3.16%
棉花	-1.43%	-3.03%
原油	-1.62%	-2.96%
PTA	0.03%	-1.74%
沪铅	0.56%	-1.42%
沪金	-0.09%	-0.89%
橡胶	-0.36%	-0.77%
豆油	0.28%	-0.76%
苹果	-0.29%	0.30%
铁矿	-3.12%	0.39%
沪铝	0.62%	0.69%
棕榈	-0.85%	0.84%
动煤	1.16%	1.43%
玉米	-1.37%	1.61%
沪锌	0.83%	1.76%
沪银	0.40%	2.00%
热卷	-0.71%	2.06%
PP	-0.98%	2.11%
沪铜	1.24%	2.11%
螺纹	-1.22%	2.44%
豆粕	-0.82%	2.89%
焦炭	-1.21%	5.59%
沥青	-2.19%	6.21%
焦煤	-0.27%	7.10%
燃油	-2.88%	7.12%
甲醇	-0.63%	7.32%
锰硅	-0.11%	8.44%

### 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	建议持多
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	建议观望 *	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（第十六期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
橡胶 1905	9	12625	12445		-16200	
焦炭 1905	4	2168	2138		-12000	
沪镍 1905	12	102930	102810		-1440	
沥青 1906	23	3306	3216		-20700	
白糖 1905						
累计盈亏					-34140	
收益率					-0.68%	

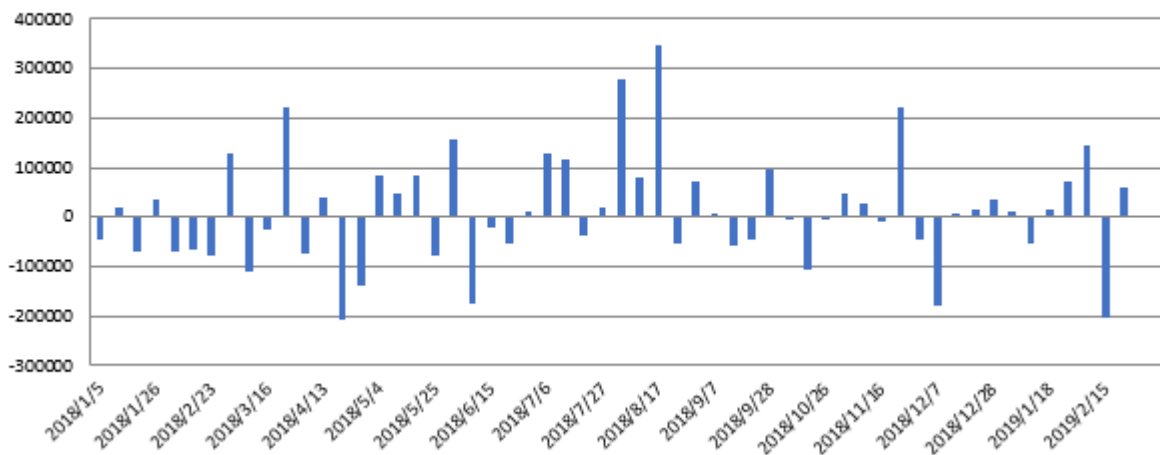
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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。