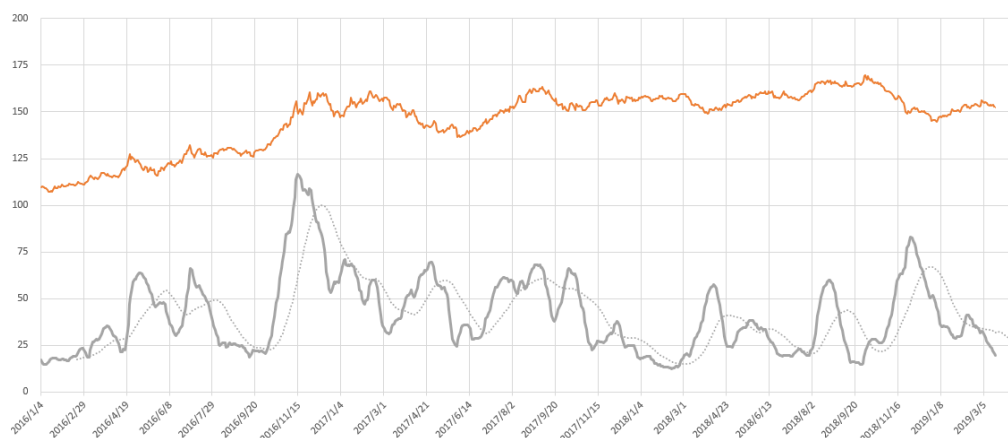


一. 商品指数走势:

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

二. 商品持仓变动:

	日涨跌	日持仓变动
锰硅	-0.72%	-9.19%
沪铝	-0.47%	-7.85%
沪铜	0.00%	-6.83%
燃油	-1.13%	-6.46%
热卷	0.25%	-5.87%
焦煤	-0.32%	-5.61%
沪锌	-0.46%	-4.27%
沪铅	-1.86%	-3.82%
焦炭	-1.34%	-3.24%
动煤	-0.41%	-3.13%
棕榈	0.35%	-2.91%
原油	-0.55%	-2.85%
螺纹	0.14%	-2.16%
沪银	0.06%	-1.19%
豆油	0.57%	-1.02%
沪金	0.09%	-0.46%
豆粕	-0.39%	-0.24%
棉花	0.42%	0.10%
橡胶	0.58%	0.68%
玉米	0.64%	2.18%
白糖	0.76%	2.46%
苹果	1.20%	2.81%
沪镍	-0.54%	3.08%
PTA	-1.70%	3.76%
沥青	-0.12%	6.70%
甲醇	-2.17%	6.72%
铁矿	1.23%	9.42%
PP	-2.06%	16.90%

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	建议观望
豆油	建议持空	铝	建议持多
豆粕	建议观望	锌	建议观望
白糖	建议观望	镍	建议观望
棉花	建议观望	白银	建议持空
焦炭	建议持空	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	建议观望 *		
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 (第十九期):

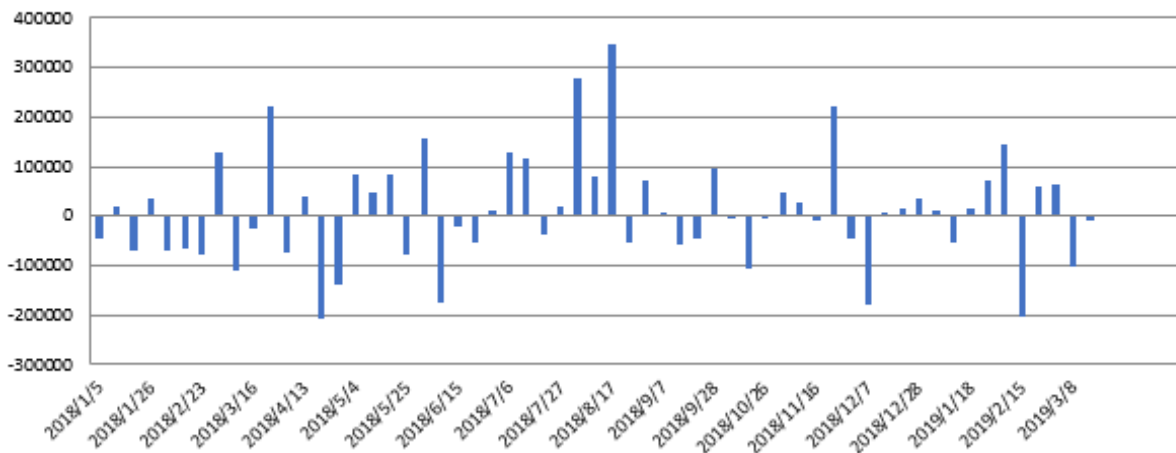
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
螺纹 1905						
沥青 1906	23	3378	3394		3680	
沪镍 1905						
锰硅 1905	35	7804	7736		-11900	
白银 1906	-35	3595	3597		-1050	
累计盈亏					-9270	
收益率					-0.19%	

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。

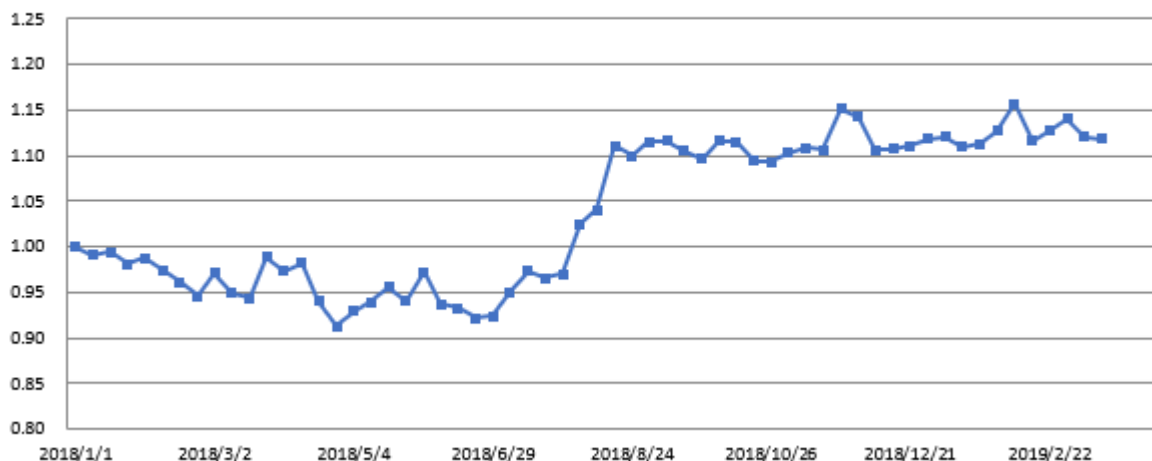
模拟盘平均开仓比例约为 15%, 历史平均年化收益 23.7%, 最大回撤 12%。

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。