

一. 商品指数走势:

文华商品指数 (持仓量: 万手、左轴)



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

投资资格号: Z0013802

二. 商品持仓变动:

	日涨跌		日持仓变动
燃油	0.94%	■	-5.53%
螺纹	1.22%	■	-5.41%
沪锌	-1.25%	■	-4.79%
豆粕	1.96%	■	-4.03%
甲醇	0.04%	■	-3.95%
焦炭	-0.30%	■	-3.80%
棕榈	0.94%	■	-3.77%
PP	0.14%	■	-2.89%
橡胶	0.00%	■	-2.49%
动煤	-0.60%	■	-2.47%
沪铜	-0.28%	■	-2.42%
苹果	0.20%	■	-2.12%
沪镍	-0.68%	■	-2.02%
沥青	1.58%	■	-2.00%
沪铝	-0.61%	■	-1.58%
沪金	0.02%		-0.07%
豆油	0.33%		0.14%
热卷	0.08%		0.61%
锰硅	-0.55%		0.73%
棉花	0.33%		0.97%
玉米	0.38%		1.11%
焦煤	-0.70%		1.32%
沪铅	-0.59%		1.76%
白糖	0.35%		1.91%
PTA	-1.19%		2.57%
铁矿	1.60%		3.00%
沪银	0.11%		3.08%
原油	1.82%		15.38%

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

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21期）：

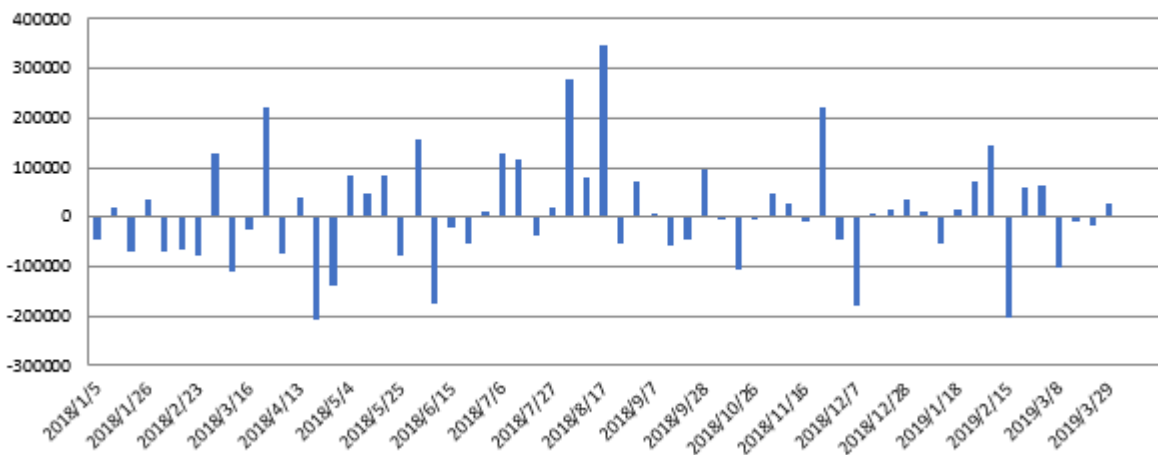
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
甲醇 1905	-40	2401	2442		-16400	
橡胶 1909	-9	11585	11680		-8550	
焦炭 1905	-4	1984.5		2011.5		-10800
PTA1905	-31	6536		6538		-310
沪镍 1905	-11	101100		102750		-18150
累计盈亏					-54210	
收益率					-1.08%	

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。

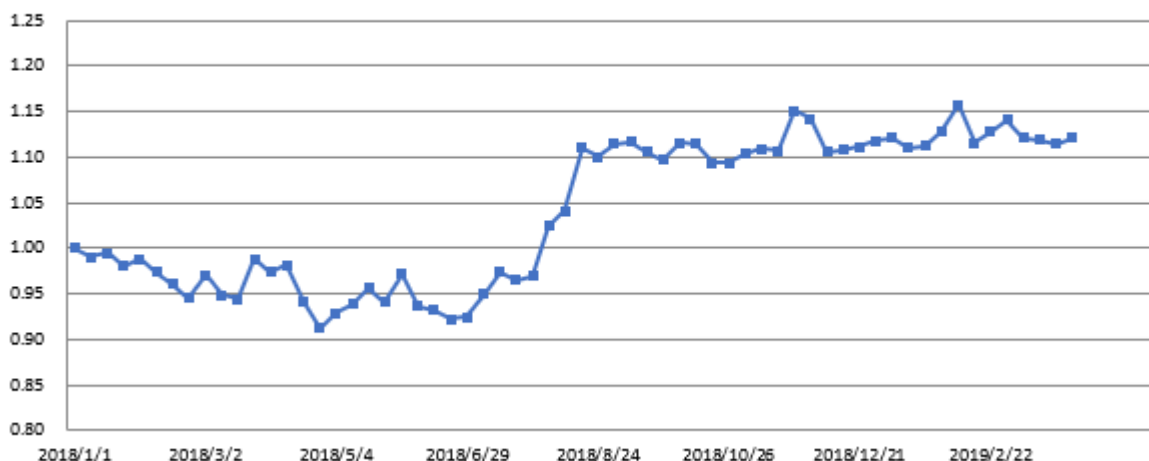
模拟盘平均开仓比例约为15%，历史平均年化收益23.7%，最大回撤12%。

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。