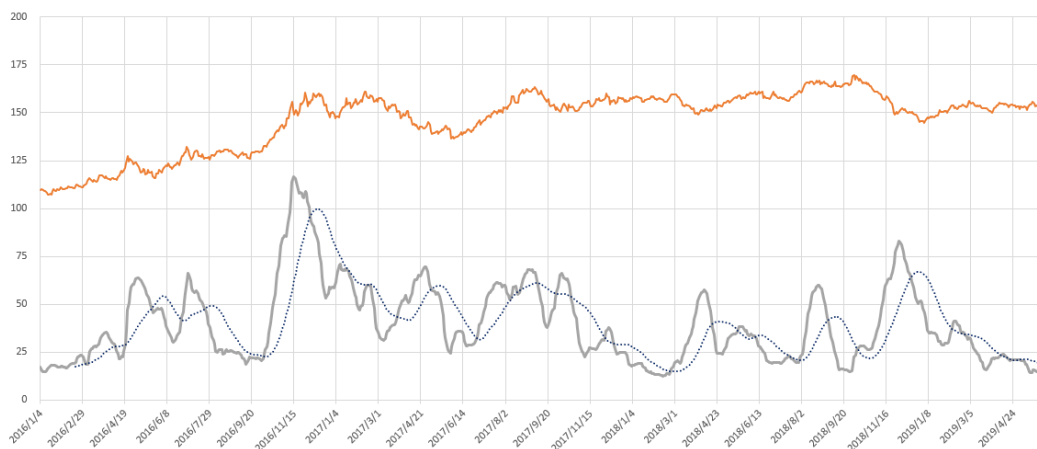


一. 商品指数走势:

文华商品指数走势与波动率对比



中融汇信投资研究中心
中融汇信量化研究

二. 商品持仓变动:

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: 上海市自由贸易试验区

东育路 255 弄 5 号 29 层

	日涨跌	日持仓变动
焦煤	-1.94%	-13.29%
甲醇	0.53%	-10.24%
沥青	-1.68%	-6.46%
锰硅	-0.33%	-3.70%
沪镍	0.75%	-3.68%
苹果	-4.05%	-3.63%
PTA	1.97%	-2.80%
沪金	0.05%	-1.81%
沪银	0.00%	-1.32%
棉花	0.26%	-0.96%
沪铜	0.28%	-0.10%
橡胶	0.12%	0.05%
沪锌	-0.39%	0.09%
动煤	-0.68%	0.42%
沪铝	0.49%	0.66%
豆油	0.52%	0.83%
热卷	-1.54%	1.10%
原油	-0.61%	1.30%
螺纹	-1.18%	1.99%
沪铅	-1.23%	2.03%
豆粕	1.95%	2.22%
PP	-0.44%	2.27%
玉米	1.31%	2.42%
白糖	-0.73%	3.08%
棕榈	0.64%	3.57%
焦炭	-2.42%	4.09%
燃油	-0.41%	4.29%
铁矿	3.57%	4.92%

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

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 29 期):

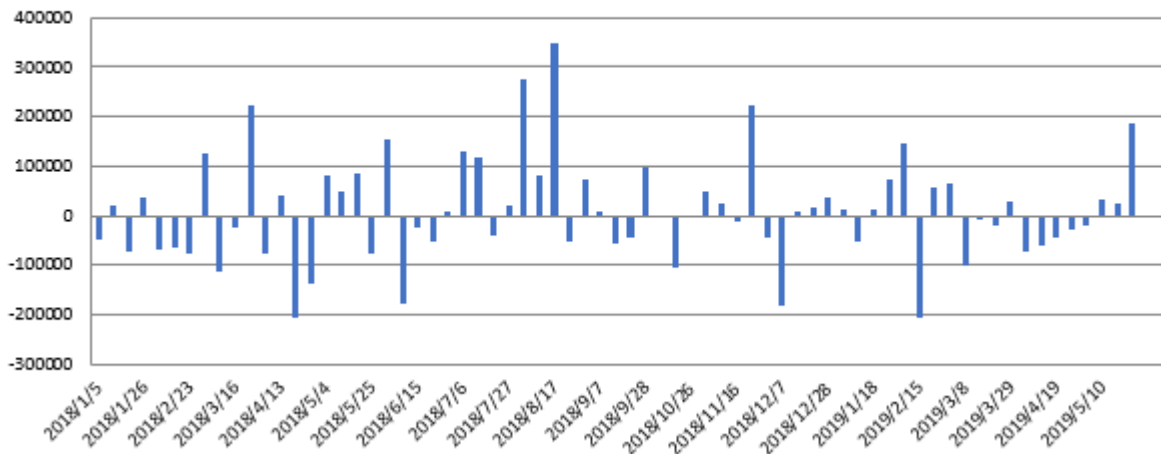
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
焦炭 1909	5	2323.5	2259		-32250	
螺纹 1909	39	3893	3842		-19890	
白糖 1909	-29	4967	4949		2610	
豆粕 1909	76	2779	2827		36480	
沥青 1912	-30	3202	3140		18600	
累计盈亏					5550	
收益率					0.11%	

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。