

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
焦炭	-0.63%	-5.98%
焦煤	0.54%	-5.50%
铁矿	-1.13%	-5.31%
PP	0.79%	-2.56%
沥青	-0.06%	-1.80%
苹果	0.63%	-1.78%
沪铅	0.00%	-1.64%
甲醇	1.92%	-1.07%
燃油	0.15%	-1.06%
锰硅	-0.05%	-0.96%
沪铜	-0.66%	-0.09%
PTA	0.11%	0.01%
沪铝	-0.46%	0.04%
沪金	0.15%	0.27%
沪镍	-1.57%	0.70%
玉米	0.60%	1.12%
热卷	-0.08%	1.40%
白糖	0.63%	1.71%
棉花	0.15%	2.34%
螺纹	-0.50%	2.80%
沪锌	-0.54%	3.84%
豆粕	2.94%	4.13%
豆油	2.80%	4.56%
橡胶	2.02%	5.25%
原油	-0.30%	5.43%
动煤	-0.85%	6.07%
沪银	-0.45%	6.43%
棕榈	2.35%	6.65%

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	建议观望 *	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	建议持空 *
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	建议观望 *	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	建议持空		
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）：

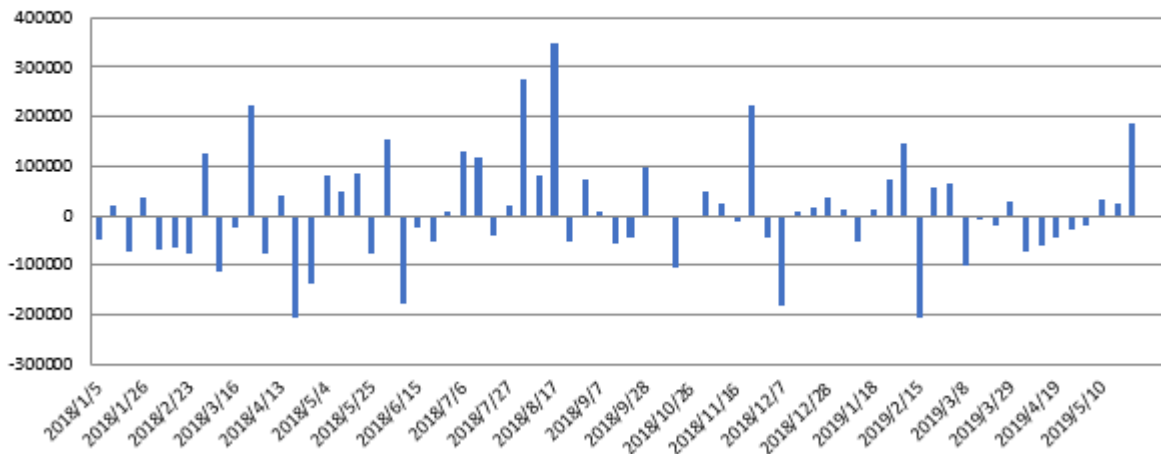
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
焦炭 1909	5	2323.5	2222		-50750	
螺纹 1910	39	3893		3805		-34320
白糖 1909	-29	4967	4974		-1015	
豆粕 1909	76	2779	2954		133000	
沥青 1912	-30	3202	3180		6600	
累计盈亏					53515	
收益率					1.07%	

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。