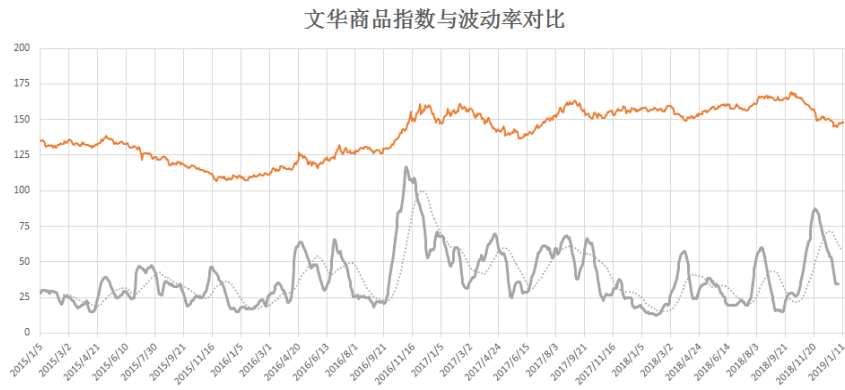


一. 商品指数走势



二. 商品持仓变动:

	日涨跌	日持仓变动
燃油	-2.44%	-8.52%
焦炭	1.67%	-4.79%
动煤	2.73%	-2.48%
棉花	0.13%	-1.71%
白糖	-0.06%	-1.41%
沪锌	-0.61%	-1.37%
PP	-1.60%	-0.08%
沪镍	-0.02%	-0.03%
沪银	-0.46%	0.14%
铁矿	0.68%	0.18%
橡胶	-1.15%	0.18%
沪铅	-0.20%	0.50%
棕榈	0.09%	0.92%
豆油	0.22%	1.12%
沪金	0.05%	1.24%
沪铝	-0.67%	1.47%
原油	-2.83%	1.79%
苹果	-0.27%	1.84%
焦煤	0.88%	2.19%
螺纹	1.02%	2.72%
热卷	0.61%	3.05%
玉米	-0.87%	3.22%
PTA	0.10%	3.28%
沥青	-1.68%	4.05%
沪铜	-0.87%	4.80%
锰硅	-0.30%	5.62%
豆粕	-2.31%	8.72%
甲醇	-0.12%	10.75%

中融汇信研究院

中融汇信量化研究小组

研究员：王禄利

从业资格号：F3051454

微信公众号：



联系方式：021-51557562

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

商品量化日报 CTA Daily Report

三. 商品操作建议:

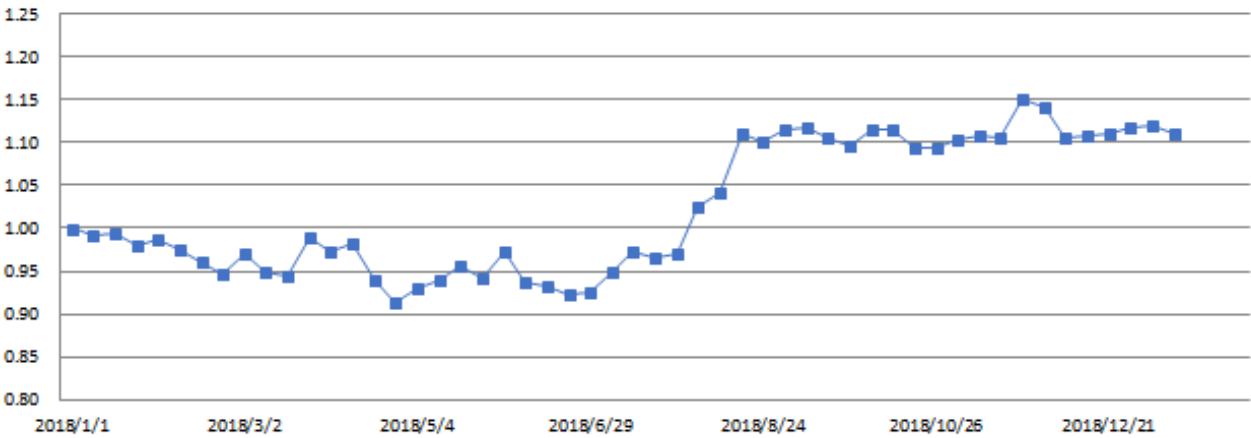
中线		中线	
玉米	建议持空	铜	建议持空
豆油	建议持多	铝	建议持空
豆粕	建议持空	锌	建议持空
白糖	建议持空	镍	建议持多
棉花	建议观望	白银	建议持多
焦炭	建议观望	橡胶	建议持多
动煤	建议持多	PTA	建议观望
螺纹	建议持多	PP	建议观望
铁矿	建议持多	沥青	建议持多
锰硅	建议持空	甲醇	建议持多
5 年期债	建议持多		
10 年期债	建议持多		
IF	建议持空		
IH	建议持空		
IC	建议持多		

四、每周模拟盘展示（第十一期）:

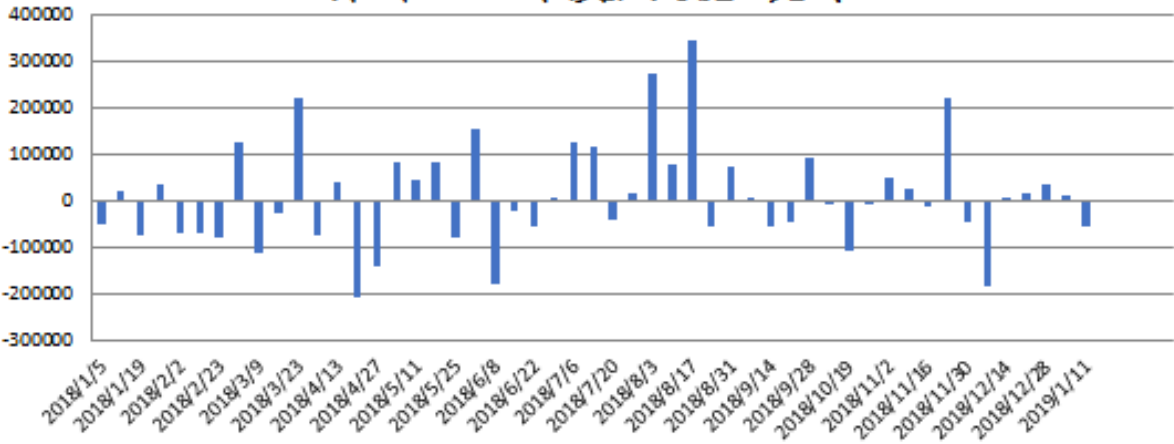
品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
锰硅 1905	-26	7320	7364		-5720	
豆油 1905	34	5576	5580		1360	
橡胶 1905	10	11580	11505		-7500	
沪银 1906	47	3721	3714		-4935	
铁矿石 1905	19	509	513		7600	
累计盈亏			-9195			
收益率			-0.18%			

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。

模拟盘策略2018年表现



策略2018年度周收益统计



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。