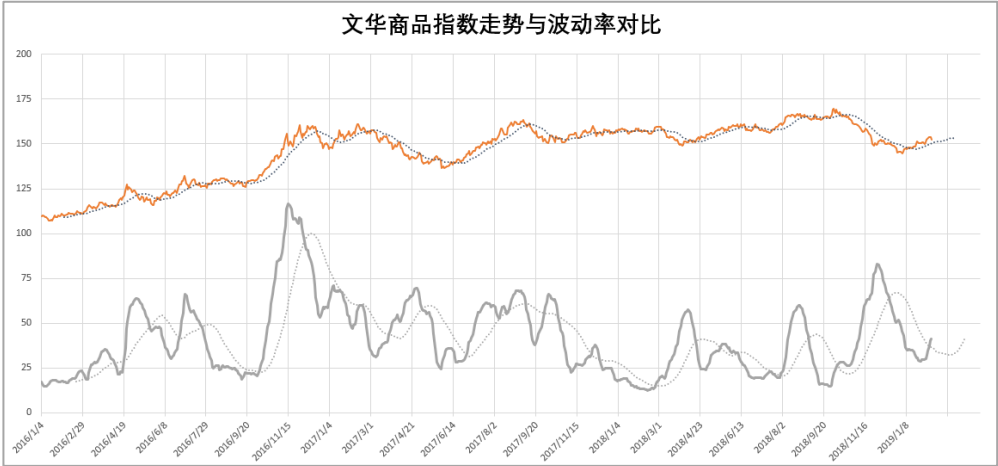


商品量化日报 CTA Daily Report

一. 商品指数走势：



中融汇信研究院
中融汇信量化研究小组

二. 商品持仓变动：

	日涨跌	日持仓变动
白糖	-1.08%	-4.54%
锰硅	-1.06%	-3.02%
苹果	-0.37%	-1.64%
豆粕	0.11%	-1.19%
沪铝	-0.04%	-0.65%
豆油	0.14%	-0.62%
焦炭	-1.69%	-0.06%
沪锌	-1.03%	0.06%
棉花	-1.24%	0.10%
甲醇	-0.86%	0.64%
螺纹	-2.06%	0.75%
铁矿	-1.76%	1.28%
沪铜	0.06%	1.62%
玉米	-0.70%	1.69%
棕榈	0.29%	1.90%
焦煤	-0.92%	1.93%
沪银	-0.21%	2.33%
橡胶	0.47%	2.67%
PTA	-3.24%	3.19%
沪金	-0.16%	3.29%
沪镍	-0.86%	3.47%
热卷	-1.73%	4.28%
沥青	-3.11%	4.93%
沪铅	-0.68%	5.07%
动煤	0.83%	5.29%
PP	-1.36%	5.65%
原油	1.56%	12.97%
燃油	2.00%	17.57%

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：

持仓周期（中线）		持仓周期（中线）	
玉米	建议持多	铜	建议持多
豆油	建议持多	铝	建议观望
豆粕	建议观望	锌	建议观望 *
白糖	建议持多	镍	建议持多
棉花	建议观望 *	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议观望
动煤	建议持多	PTA	建议持多
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	建议持多	甲醇	建议观望 *
5 年期债	建议持多		
10 年期债	建议持多		
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

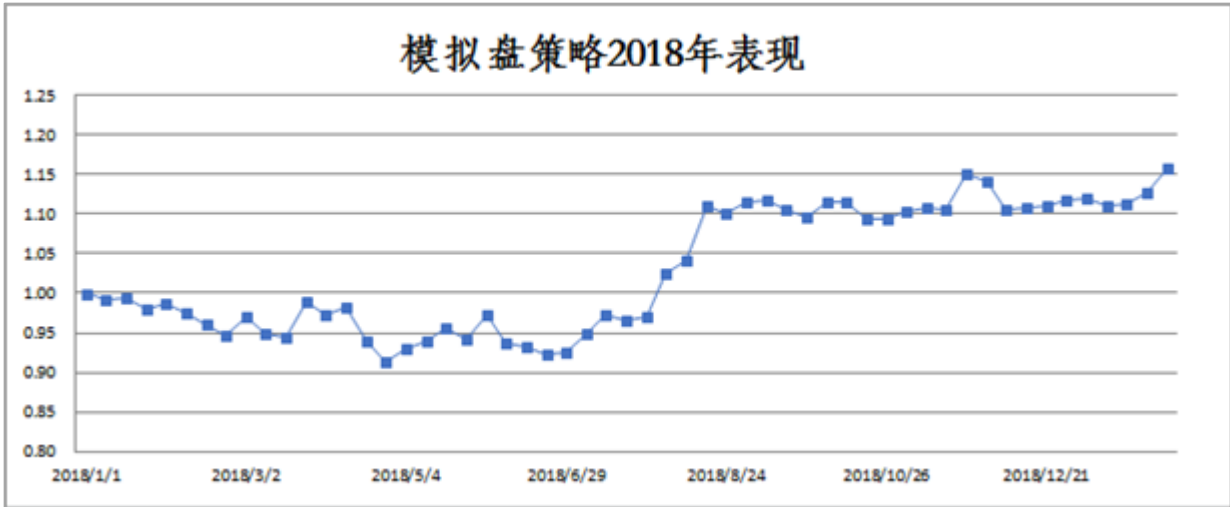
四、每周模拟盘展示（第十四期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
焦炭 1905	5	2166	2066		-50000	
沪锌 1905	11	22300		21455		-46475
沪镍 1905	12	100000	98350		-19800	
沥青 1906	23	3248	3192		-12880	
白糖 1905	35	5072	5120		16800	
累计盈亏					-112355	
收益率					-2.25%	

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。



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。