

商品量化日报 CTA Daily Report

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	-1.04%	-7.40%
沥青	1.08%	-3.20%
豆粕	1.42%	-1.87%
动煤	0.00%	-1.87%
铁矿	-0.40%	-1.73%
沪镍	-0.23%	-1.44%
焦煤	-0.43%	-1.35%
燃油	1.25%	-1.15%
苹果	-1.89%	-0.98%
沪金	-0.07%	-0.95%
棉花	0.84%	-0.87%
沪铜	-0.28%	-0.79%
沪锌	1.16%	-0.77%
豆油	0.30%	-0.58%
沪银	-0.17%	-0.53%
PTA	0.19%	-0.25%
沪铝	-0.39%	-0.04%
白糖	0.37%	0.22%
螺纹	-0.03%	0.28%
玉米	-0.45%	1.07%
橡胶	0.79%	1.27%
PP	0.98%	1.61%
原油	1.07%	3.56%
棕榈	0.05%	4.05%
热卷	0.00%	4.25%
沪铅	-0.56%	4.40%
锰硅	1.10%	9.06%
甲醇	0.04%	11.80%

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	2237		-43250	
螺纹 1910	39	3893	3845		-18720	
白糖 1909	-29	4967	4950		2465	
豆粕 1909	76	2779	2867		66880	
沥青 1912	-30	3202	3182		6000	
累计盈亏			13375			
收益率			0.27%			

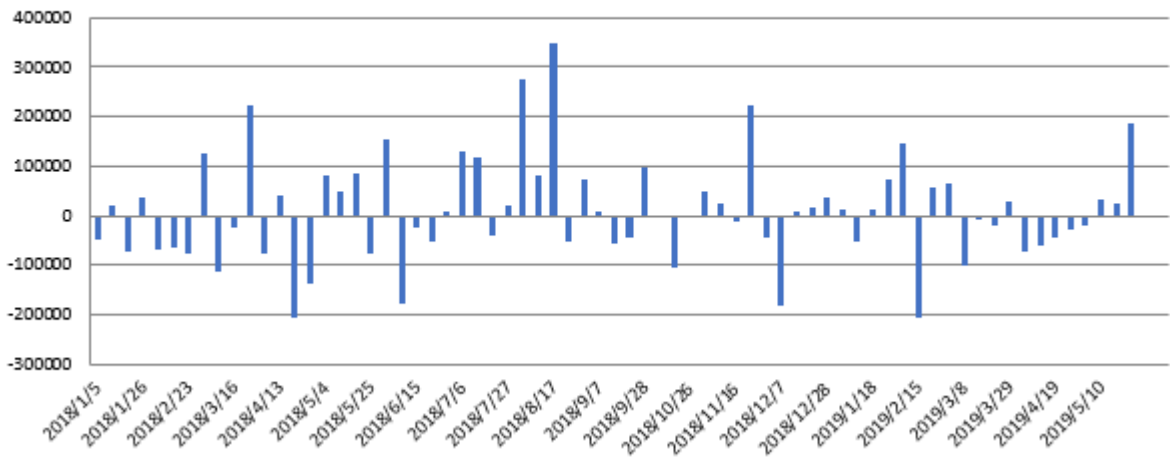
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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%。

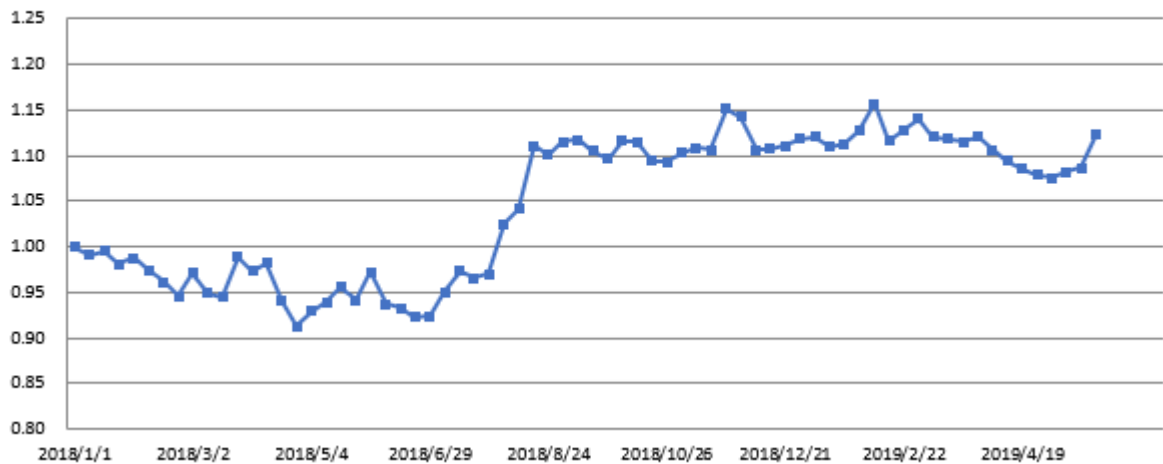
选品种详细参阅量化择时周报，每周商品热点跟踪。模拟盘组合按照总资金 2%止损。

商品量化日报 CTA Daily Report

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。