

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
螺纹	2.99%	-3.78%
沪银	-0.80%	-3.29%
热卷	2.18%	-3.11%
沥青	2.82%	-2.98%
苹果	1.25%	-2.07%
沪锌	0.83%	-1.20%
沪铜	1.30%	-0.85%
PP	0.30%	-0.62%
豆粕	0.07%	-0.05%
沪铝	0.65%	-0.02%
豆油	0.15%	0.11%
沪金	-0.42%	0.21%
燃油	-0.04%	0.21%
棉花	1.75%	0.25%
PTA	-0.34%	0.38%
白糖	0.26%	0.49%
动煤	1.02%	0.58%
原油	-0.39%	0.96%
沪铅	-0.09%	1.78%
玉米	-0.15%	2.51%
棕榈	0.00%	3.62%
焦炭	3.65%	3.94%
橡胶	1.36%	4.12%
沪镍	1.01%	4.29%
铁矿	4.32%	8.76%
甲醇	0.60%	11.19%
焦煤	1.59%	13.17%
锰硅	1.90%	16.63%

三. 商品操作建议:

持仓周期 (中线)		持仓周期 (中线)	
玉米	建议观望	铜	建议持空
棕油	建议观望	铝	建议持空
豆粕	建议持多	锌	建议持空
白糖	建议持空	镍	建议持空
棉花	建议持空	白银	建议持多
焦炭	建议观望	橡胶	建议持多
动煤	建议观望	PTA	建议持空
螺纹	建议观望	PP	建议持空
铁矿	建议观望	沥青	建议持空
锰硅	建议持多 *	甲醇	建议持空
5年期债	建议观望		
10年期债	建议观望		
IF	建议持多 *		
IH	建议持多 *		
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 31 期):

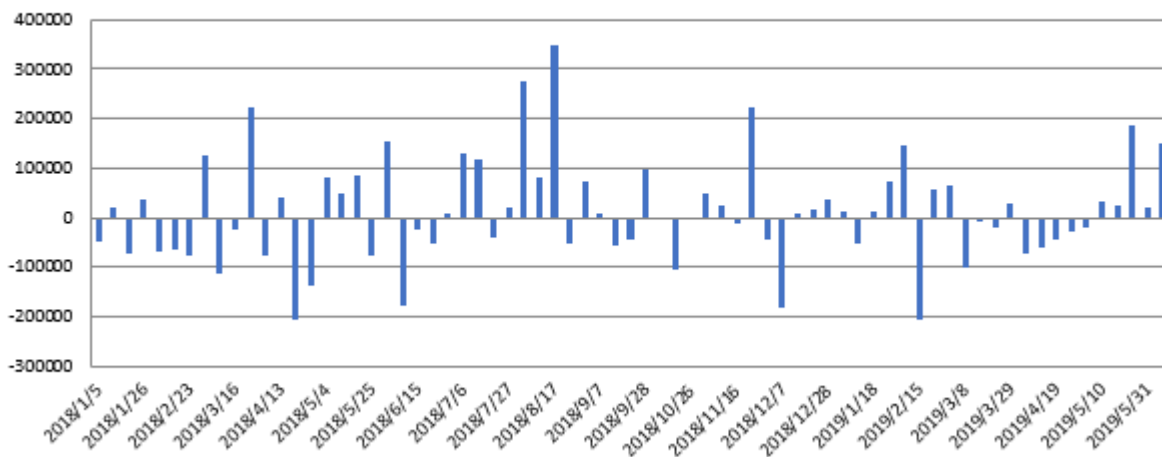
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
棉花 1909	-25	12720		13200		-60000
沥青 1912	-26	2982		3058		-19760
PTA1909	-38	5270		5294		-4560
豆粕 1909	72	2850		2868		12960
沪铜 1907	-10	46150		46730		-29000
累计盈亏					-100000	
收益率					-2.0%	

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。