

一. 商品指数走势

文华商品指数与波动率对比



二. 商品持仓变动:

	日涨跌	日持仓变动
豆粕	0.65%	-5.36%
PP	0.38%	-5.16%
锰硅	1.00%	-4.19%
螺纹钢	1.91%	-4.02%
热卷	2.37%	-3.24%
沪铜	-0.60%	-2.49%
沪银	-0.17%	-1.45%
铁矿	0.93%	-1.14%
白糖	0.02%	-0.95%
棉花	0.07%	-0.54%
玉米	0.32%	-0.50%
橡胶	0.59%	-0.34%
豆油	-0.18%	0.07%
沪铅	0.30%	0.35%
苹果	1.05%	0.48%
沪金	0.20%	0.87%
动煤	-0.41%	1.10%
沪铝	-0.54%	1.40%
沪锌	0.26%	1.92%
PTA	2.97%	2.24%
棕榈	0.23%	3.06%
燃油	-0.57%	3.34%
焦炭	0.33%	3.40%
甲醇	0.96%	3.75%
沪镍	-1.02%	4.24%
焦煤	0.99%	4.95%
原油	-1.52%	6.01%
沥青	-1.37%	17.44%

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

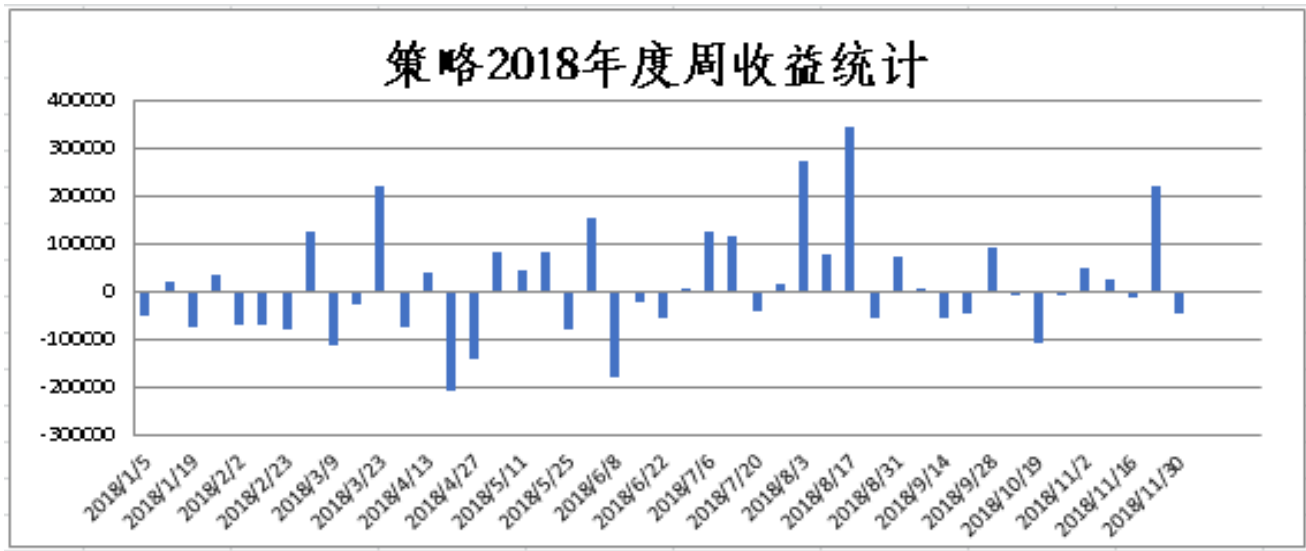
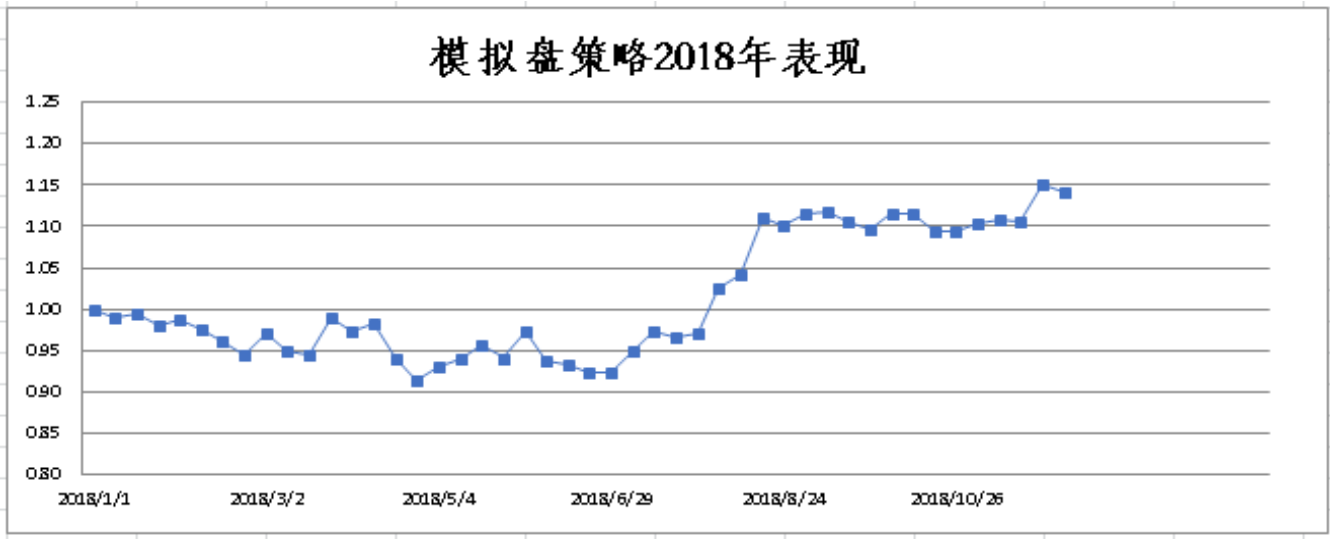
三. 商品操作建议:

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

四、每周模拟盘展示（第五期）:

品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
焦炭 1901	-3	2130	2337		-62100	
沥青 1906	-28	2794	2870		-21280	
沪锌 1901	-9	20700	21285		-26325	
螺纹钢 1901	-26	3590	3798		-54080	
白糖 1905	-30	4931	4884		14100	
累计盈亏			-149685			
收益率			-2.99%			

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。