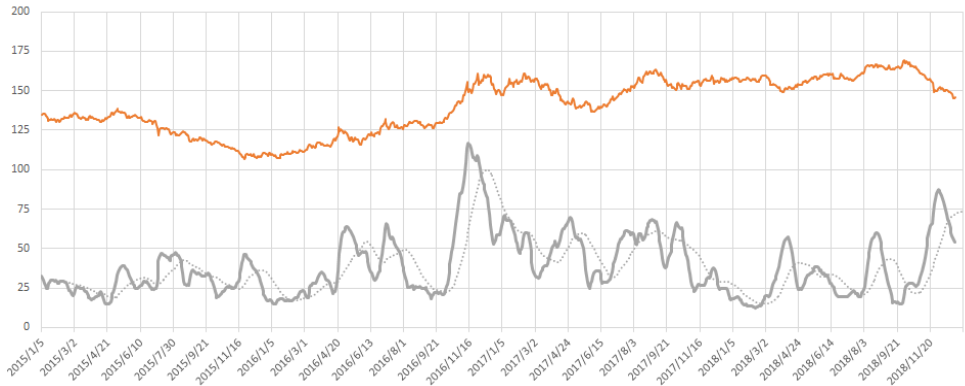


一. 商品指数走势

文华商品指数与波动率对比



二. 商品持仓变动:

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

	日涨跌	日持仓变动
燃油	5.77%	-14.74%
原油	7.00%	-13.65%
锰硅	-1.10%	-10.84%
沪铅	0.59%	-4.25%
沪铜	0.52%	-3.98%
PP	1.05%	-3.92%
PTA	-0.10%	-3.81%
动煤	1.04%	-3.70%
苹果	-0.34%	-3.68%
铁矿	-0.30%	-3.10%
焦煤	-0.25%	-3.01%
沪锌	-0.02%	-2.70%
橡胶	1.99%	-2.57%
沪金	-0.42%	-2.18%
棉花	0.54%	-2.01%
棕榈	0.40%	-1.56%
沪铝	-0.91%	-0.99%
玉米	-0.22%	-0.33%
沪镍	0.93%	0.45%
豆粕	-0.49%	0.50%
螺纹	-0.56%	0.81%
豆油	-0.26%	2.69%
热卷	-1.07%	5.30%
沥青	2.56%	5.44%
焦炭	-0.55%	5.77%
沪银	0.61%	6.14%
甲醇	1.54%	10.18%
白糖	-1.84%	12.91%

商品量化日报 CTA Daily Report

三. 商品操作建议:

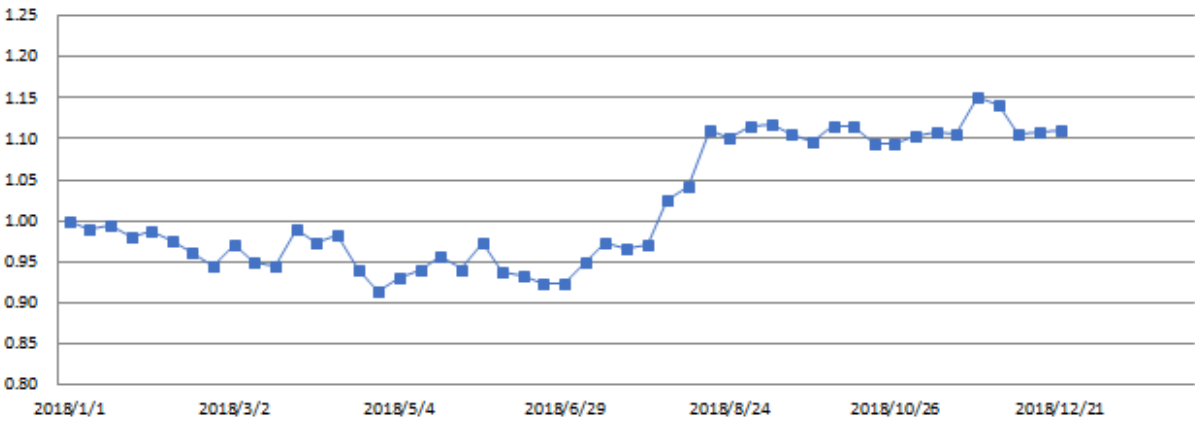
中线		中线	
玉米	建议持空	铜	建议持空
豆油	建议观望	铝	建议观望
豆粕	建议持空	锌	建议观望
白糖	建议持空	镍	建议持空
棉花	建议持空	白银	建议持多
焦炭	建议持空	橡胶	建议观望
动煤	建议持空	PTA	建议持空
螺纹	建议观望	PP	建议观望
铁矿	建议持多	沥青	建议持空
锰硅	建议持空	甲醇	建议持空
5 年期债	建议观望		
10 年期债	建议观望		
IF	建议持空		
IH	建议持空		
IC	建议持空		

四、每周模拟盘展示（第八期）:

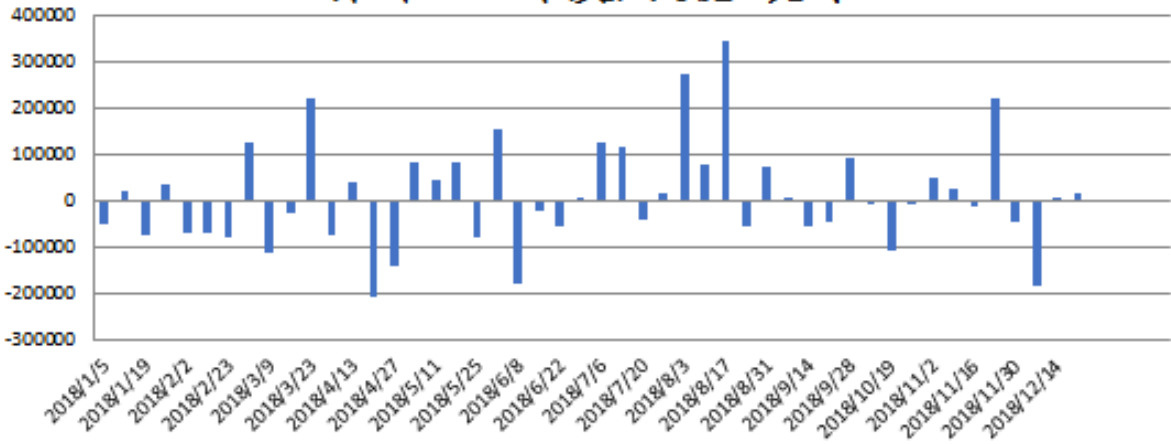
品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
锰硅 1905	-26	7236	7264		-3640	
沥青 1906	-28	2730	2640		25200	
豆粕 1905	-43	2661	2625		15480	
沪铜 1902	-7	48300	48280		700	
铁矿石 1905	19	497	491.5		-10450	
累计盈亏			27290			
收益率			0.55%			

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。