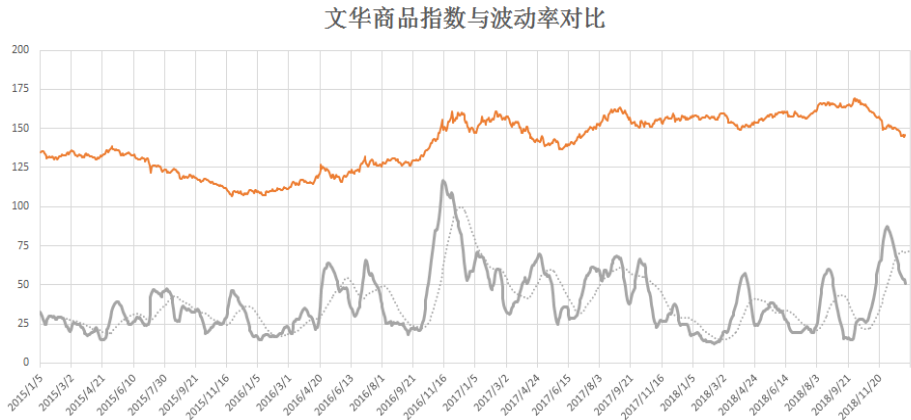


一. 商品指数走势



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   |
|-----|--------|---------|
| 沪镍  | 2.37%  | -10.28% |
| 原油  | 3.77%  | -5.26%  |
| 玉米  | 0.54%  | -3.00%  |
| 热卷  | 1.58%  | -2.67%  |
| 燃油  | 1.48%  | -2.04%  |
| 沪锌  | -0.50% | -1.35%  |
| 焦煤  | 2.37%  | -1.07%  |
| 沥青  | 1.94%  | -0.84%  |
| 棕榈  | 0.70%  | -0.81%  |
| PP  | 0.41%  | -0.42%  |
| PTA | 1.32%  | -0.34%  |
| 苹果  | -1.95% | -0.26%  |
| 锰硅  | 1.29%  | -0.06%  |
| 豆粕  | 0.53%  | 0.25%   |
| 棉花  | -0.10% | 0.73%   |
| 甲醇  | 1.79%  | 1.42%   |
| 螺纹  | 2.05%  | 1.48%   |
| 沪铝  | -0.74% | 1.48%   |
| 橡胶  | 1.41%  | 2.18%   |
| 动煤  | -0.49% | 2.36%   |
| 沪金  | 0.83%  | 2.55%   |
| 沪铜  | -0.67% | 2.80%   |
| 白糖  | -0.32% | 3.65%   |
| 沪银  | 1.40%  | 4.29%   |
| 豆油  | 1.29%  | 5.55%   |
| 沪铅  | -1.22% | 5.95%   |
| 铁矿  | 1.52%  | 10.74%  |
| 焦炭  | 3.12%  | 11.27%  |

商品量化日报 CTA Daily Report

三. 商品操作建议:

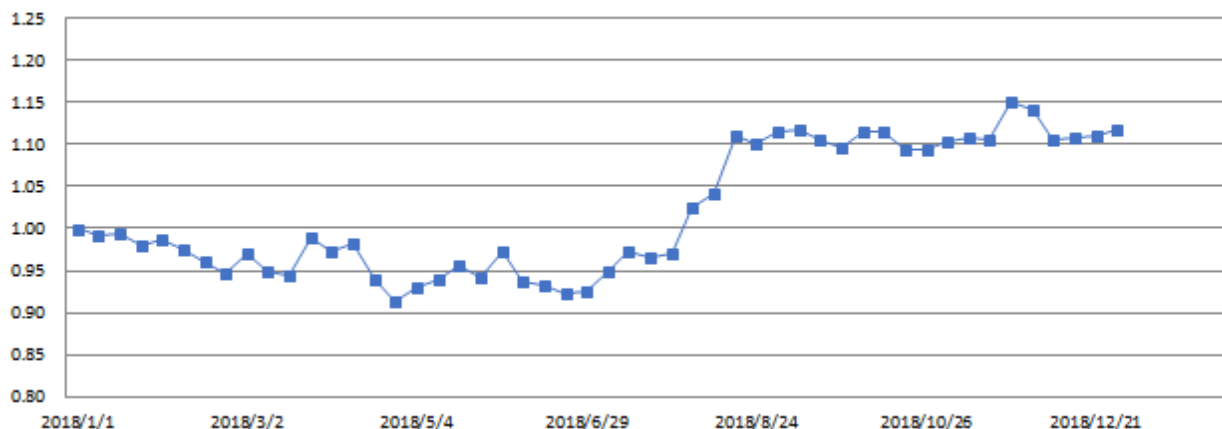
| 中线     |      | 中线  |      |
|--------|------|-----|------|
| 玉米     | 建议持空 | 铜   | 建议持空 |
| 豆油     | 建议观望 | 铝   | 建议持空 |
| 豆粕     | 建议持空 | 锌   | 建议持空 |
| 白糖     | 建议持空 | 镍   | 建议持空 |
| 棉花     | 建议持空 | 白银  | 建议持多 |
| 焦炭     | 建议持空 | 橡胶  | 建议观望 |
| 动煤     | 建议持空 | PTA | 建议持空 |
| 螺纹     | 建议观望 | PP 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

四、每周模拟盘展示（第九期）:

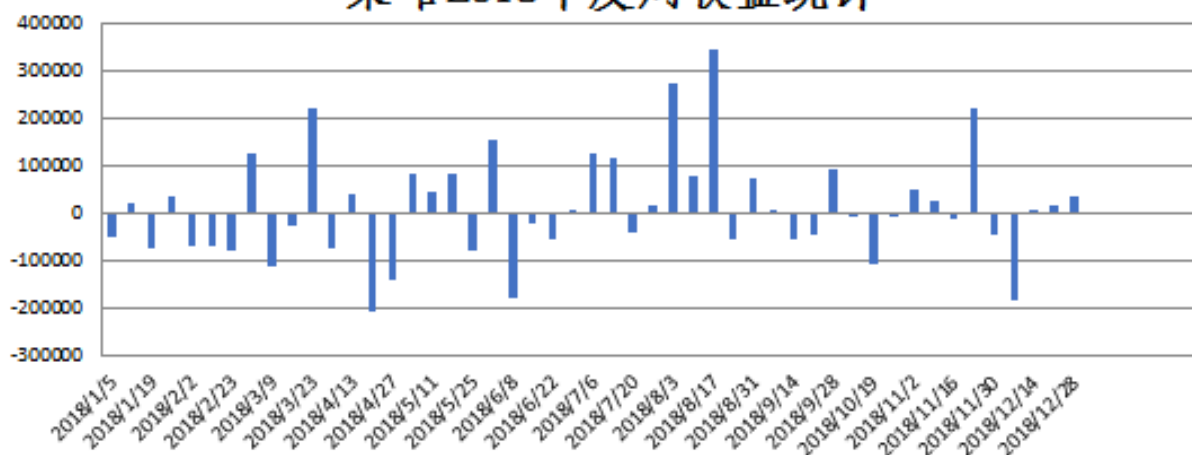
| 品种       | 买卖手 | 开仓价   | 最新价   | 平仓价格 | 持仓盈亏   | 平仓盈亏 |
|----------|-----|-------|-------|------|--------|------|
| 锰硅 1905  | -26 | 7288  | 7312  |      | -3120  |      |
| 沥青 1906  | -28 | 2636  | 2630  |      | 1680   |      |
| 豆粕 1905  | -43 | 2625  | 2661  |      | -15480 |      |
| 沪银 1906  | 47  | 3700  | 3762  |      | 43710  |      |
| 铁矿石 1905 | 19  | 496.5 | 497   |      | 950    |      |
| 累计盈亏     |     |       | 27740 |      |        |      |
| 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。