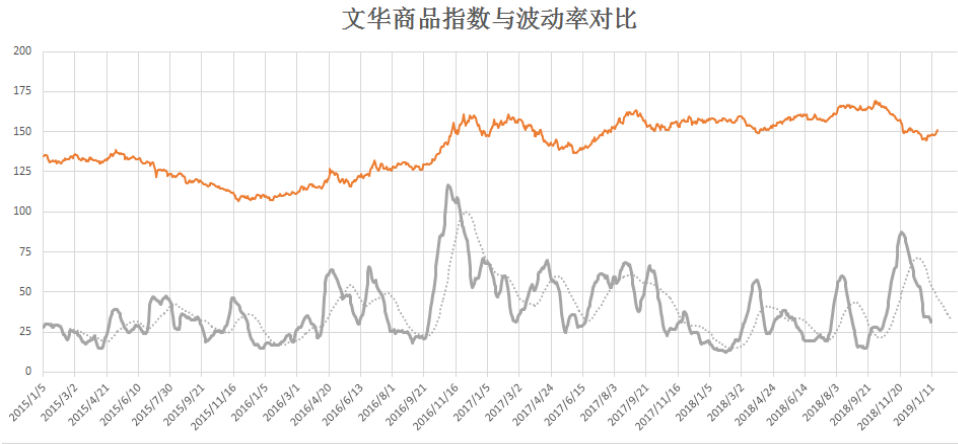


一. 商品指数走势



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
焦炭	-1.70%	-7.42%
沪锌	-0.30%	-5.71%
锰硅	-0.35%	-5.26%
沪银	-1.32%	-3.44%
苹果	1.31%	-2.40%
热卷	-0.09%	-2.21%
PP	0.26%	-1.37%
沪铅	0.00%	-1.18%
沪镍	0.98%	-1.17%
豆油	1.79%	-0.81%
沪铜	-0.13%	-0.77%
螺纹	0.33%	-0.60%
玉米	0.49%	-0.60%
豆粕	0.89%	-0.30%
棕榈	1.62%	-0.25%
沪铝	0.37%	0.16%
铁矿	0.85%	1.09%
白糖	2.87%	1.68%
动煤	-0.54%	2.67%
沪金	-0.65%	2.69%
橡胶	1.62%	2.99%
原油	1.60%	3.46%
焦煤	-1.96%	4.69%
甲醇	3.01%	6.27%
棉花	0.65%	6.61%
PTA	2.87%	6.97%
沥青	3.56%	7.08%
燃油	1.61%	10.67%

商品量化日报 CTA Daily Report

三. 商品操作建议:

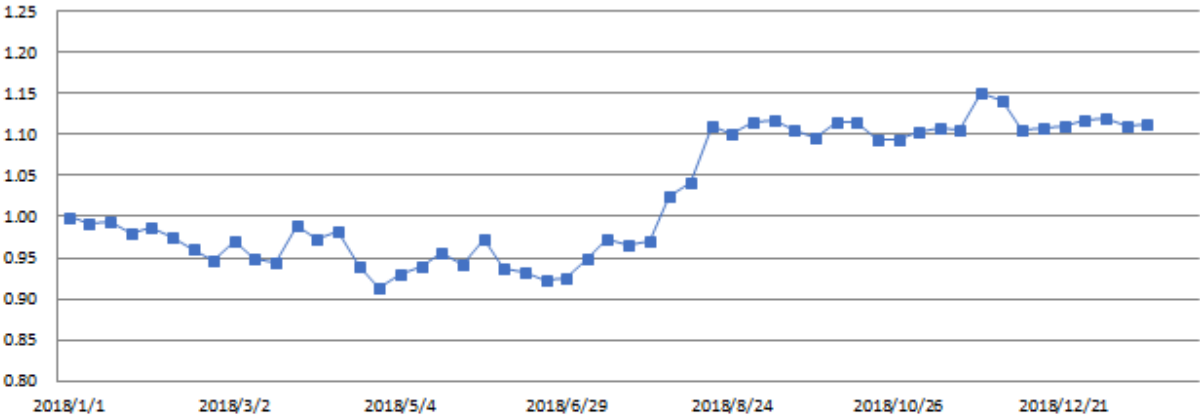
中线		中线	
玉米	建议持空	铜	建议观望
豆油	建议持多	铝	建议观望
豆粕	建议持空	锌	建议持多
白糖	建议持多	镍	建议持多
棉花	建议持多	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议持多
动煤	建议持多	PTA	建议持多
螺纹	建议持多	PP	建议持多
铁矿	建议持多	沥青	建议持多
锰硅	建议观望	甲醇	建议持多
5 年期债	建议持多		
10 年期债	建议持多		
IF	建议持多		
IH	建议持多		
IC	建议持多		

四、每周模拟盘展示（第十二期）:

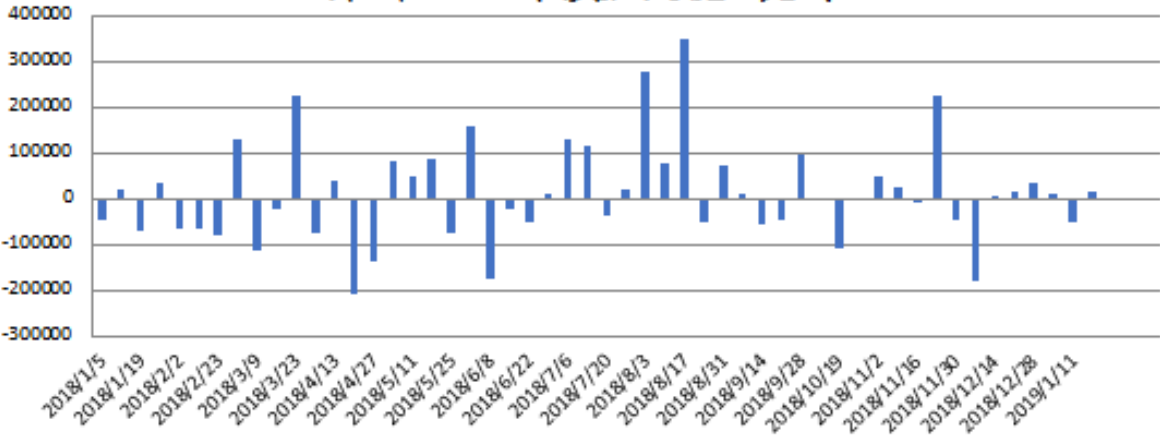
品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
豆粕 1905	-59	2569	2585		-9440	
螺纹 1905	34	3636	3645		3060	
沪镍 1905	12	94030	94980		11400	
沥青 1906	23	2974	3084		25300	
铁矿 1905	19	528.5	533		8550	
累计盈亏			38870			
收益率			0.78%			

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。