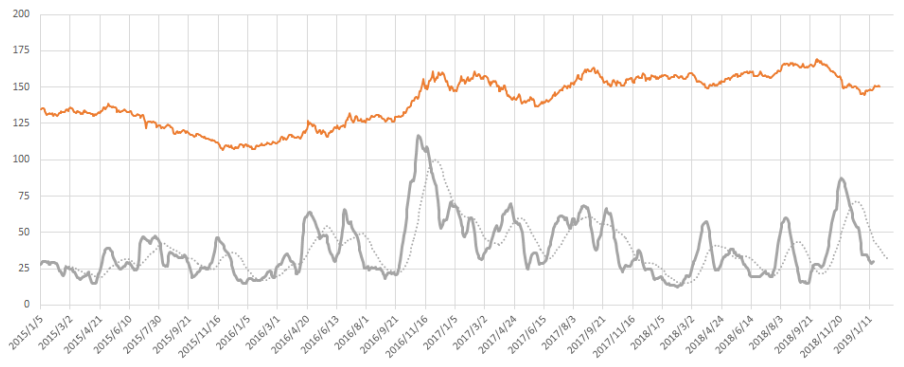


一. 商品指数走势

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
焦煤	0.82%	-11.04%
锰硅	1.19%	-7.51%
沥青	-1.21%	-6.82%
沪铅	0.26%	-5.39%
玉米	-0.48%	-3.82%
甲醇	-2.03%	-3.71%
沪镍	0.20%	-3.55%
热卷	-0.59%	-3.42%
铁矿	2.99%	-3.06%
螺纹钢	-0.84%	-3.00%
PTA	-1.81%	-2.97%
动煤	0.07%	-2.35%
PP	0.06%	-2.34%
沪铜	0.38%	-2.23%
苹果	-0.19%	-1.71%
橡胶	-0.47%	-0.80%
豆粕	-0.15%	-0.16%
棉花	0.03%	0.16%
白糖	-0.64%	0.40%
沪铝	-0.22%	1.83%
豆油	1.65%	2.69%
燃油	-1.64%	3.07%
沪金	0.97%	4.63%
沪银	1.86%	4.70%
沪锌	1.24%	5.01%
焦炭	-0.37%	5.07%
原油	-2.02%	6.43%
棕榈	1.34%	9.39%

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

商品量化日报 CTA Daily Report

三. 商品操作建议:

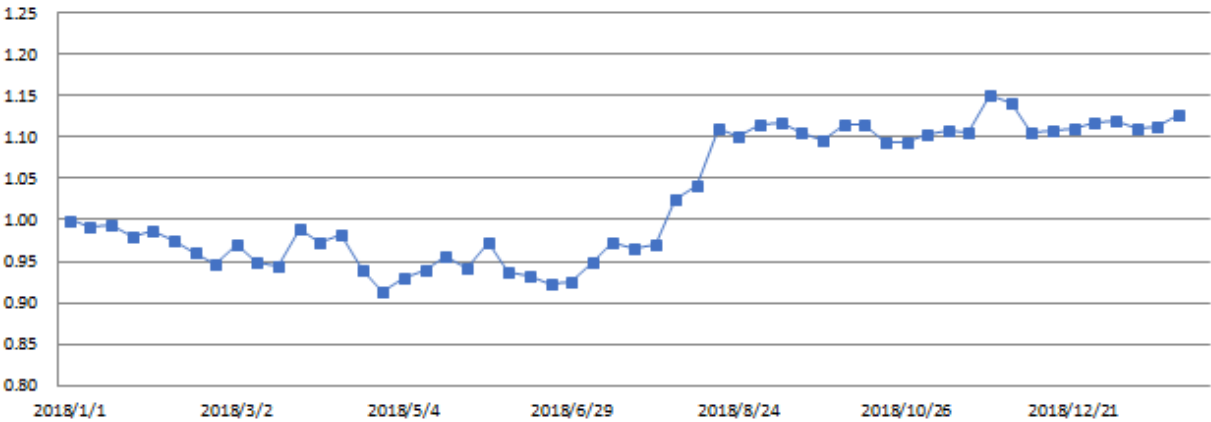
中线		中线	
玉米	建议持多	铜	建议观望
豆油	建议持多	铝	建议观望
豆粕	建议持空	锌	建议持多
白糖	建议持多	镍	建议持多
棉花	建议持多	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议持多
动煤	建议持多	PTA	建议持多
螺纹	建议持多	PP	建议持多
铁矿	建议持多	沥青	建议持多
锰硅	建议持空	甲醇	建议观望
5 年期债	建议持多		
10 年期债	建议持多		
IF	建议持多		
IH	建议持多		
IC	建议持多		

四、每周模拟盘展示（第十三期）:

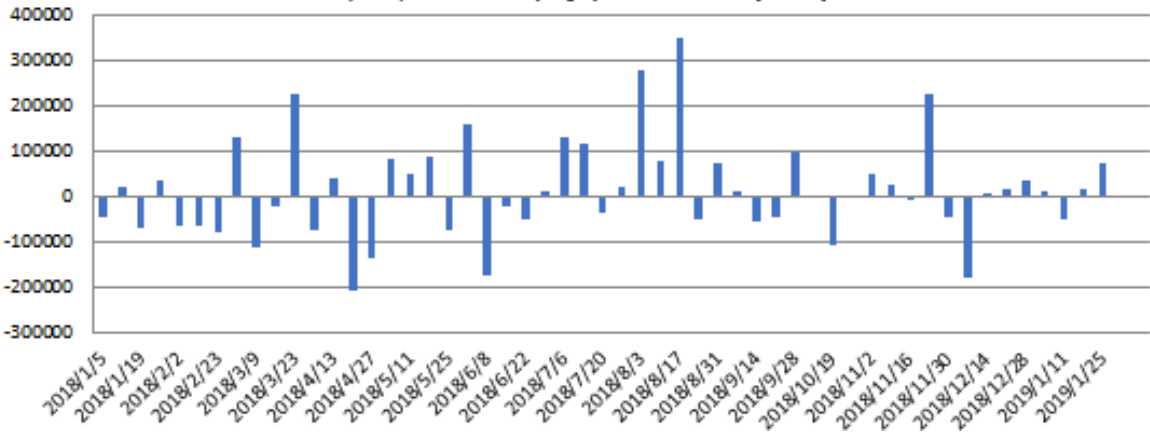
品种	买卖手	开仓价	最新价	平仓价格	持仓盈亏	平仓盈亏
PTA1905	33	6444	6354		-14850	
螺纹 1905	34	3712	3681		-10540	
沪镍 1905	12	94800	95050		3000	
沥青 1906	23	3130	3104		-5980	
豆油 1905	34	5690	5790		34000	
累计盈亏			5630			
收益率			0.11%			

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。