

商品量化日报 CTA Daily Report

一. 商品指数走势：

文华商品指数走势与波动率对比



中融汇信研究院
中融汇信量化研究小组

二. 商品持仓变动：

研究员：徐坚
从业资格号：F3052114
投询资格号：Z0013802

	日涨跌	日持仓变动
焦煤	-0.43%	-7.32%
沥青	1.19%	-6.17%
锰硅	0.19%	-3.22%
焦炭	1.07%	-2.49%
热卷	-0.20%	-2.11%
白糖	-1.76%	-1.46%
沪铅	0.90%	-0.96%
苹果	0.02%	-0.50%
沪铝	0.30%	-0.20%
豆油	-0.03%	-0.12%
豆粕	-0.57%	0.03%
沪镍	0.54%	0.13%
沪银	-0.78%	0.15%
沪锌	0.35%	0.31%
PP	0.56%	0.44%
棉花	0.23%	0.48%
PTA	-0.13%	1.14%
沪金	-0.23%	1.18%
橡胶	0.98%	1.27%
沪铜	0.39%	2.79%
玉米	-0.86%	3.41%
棕榈	0.00%	3.47%
动煤	0.31%	3.72%
铁矿	0.73%	4.63%
螺纹	-0.49%	5.66%
燃油	1.89%	10.11%
甲醇	1.77%	10.88%
原油	2.23%	11.42%

微信公众号：



联系方式：021-51557572
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：

持仓周期（中线）		持仓周期（中线）	
玉米	建议观望 *	铜	建议持多
豆油	建议持多	铝	建议观望
豆粕	建议观望	锌	建议观望
白糖	建议持多	镍	建议持多
棉花	建议观望	白银	建议观望
焦炭	建议持多	橡胶	建议观望
动煤	建议持多	PTA	建议持多
螺纹	建议持多	PP	建议观望
铁矿	建议持多	沥青	建议持多
锰硅	建议持多	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		

说明：带 “*” 标注为当日操作变化

四、每周模拟盘展示（第十四期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
焦炭 1905	5	2166	2088.5		-38750	
沪锌 1905	11	22300		21455		-46475
沪镍 1905	12	100000	98890		-13320	
沥青 1906	23	3248	3230		-4140	
白糖 1905	35	5072	5020		-18200	
累计盈亏					-120885	
收益率					-2.42%	

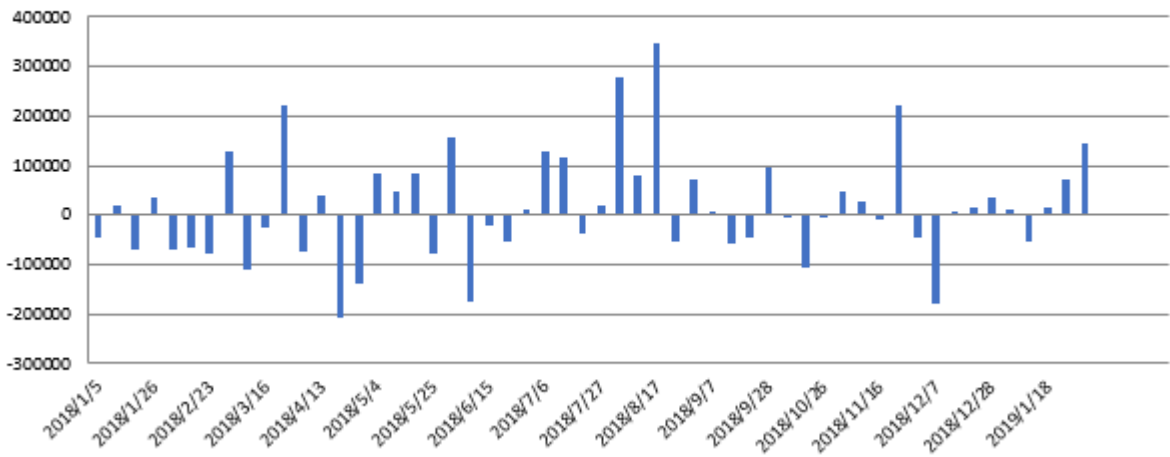
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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%。

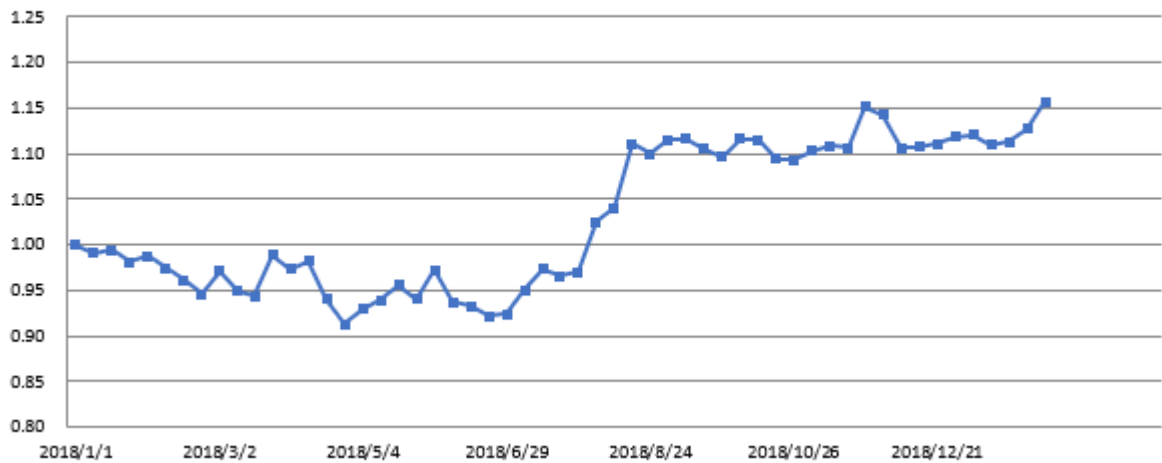
选品种详细参阅量化择时周报，每周商品热点跟踪。

商品量化日报 CTA Daily Report

选品种策略周收益统计



选品种策略周净值走势



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。