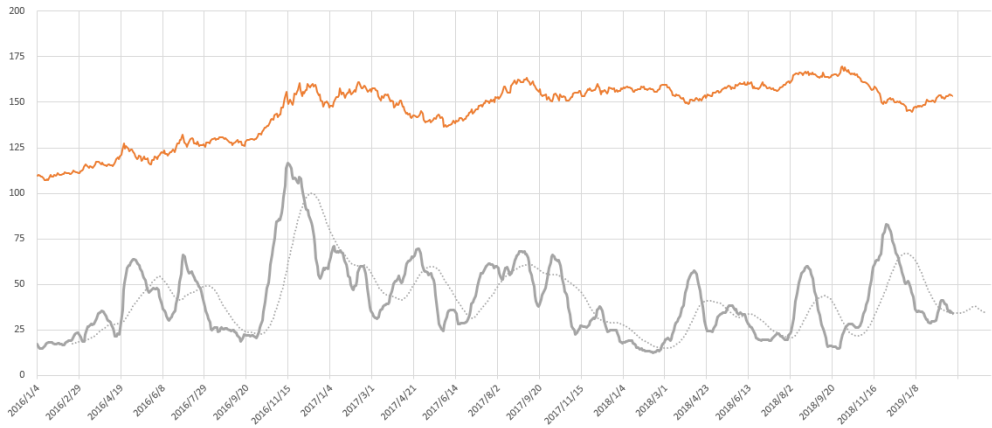


商品量化日报 CTA Daily Report

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

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

	日涨跌	日持仓变动
焦炭	0.23%	-10.18%
燃油	-1.94%	-4.21%
沥青	-0.31%	-4.06%
棉花	-0.90%	-3.32%
沪镍	-0.91%	-3.00%
焦煤	0.27%	-2.96%
铁矿	-0.93%	-2.33%
PP	1.08%	-2.21%
锰硅	0.29%	-2.19%
橡胶	-0.36%	-1.96%
螺纹	1.32%	-1.80%
沪银	-0.56%	-1.12%
甲醇	1.27%	-1.04%
沪锌	-0.80%	-0.86%
苹果	-0.34%	-0.73%
沪铝	-0.51%	-0.12%
原油	-3.49%	0.00%
沪铜	-0.61%	0.39%
动煤	0.37%	0.46%
豆粕	0.04%	0.82%
沪金	-0.07%	1.15%
豆油	-1.46%	1.28%
PTA	-1.00%	1.57%
沪铅	-0.58%	1.71%
玉米	0.33%	2.97%
白糖	0.58%	3.13%
棕榈	-1.96%	4.66%
热卷	1.79%	7.84%

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	建议持空	铜	建议持多
豆油	建议观望 *	铝	建议持多
豆粕	建议持空	锌	建议观望
白糖	建议持多 *	镍	建议持多
棉花	建议持多	白银	建议持多
焦炭	建议持多	橡胶	建议持多
动煤	建议持多	PTA	建议观望
螺纹	建议观望	PP	建议观望
铁矿	建议观望	沥青	建议持多
锰硅	建议持多	甲醇	建议观望
5 年期债	建议观望		
10 年期债	建议观望		
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（第十六期）：

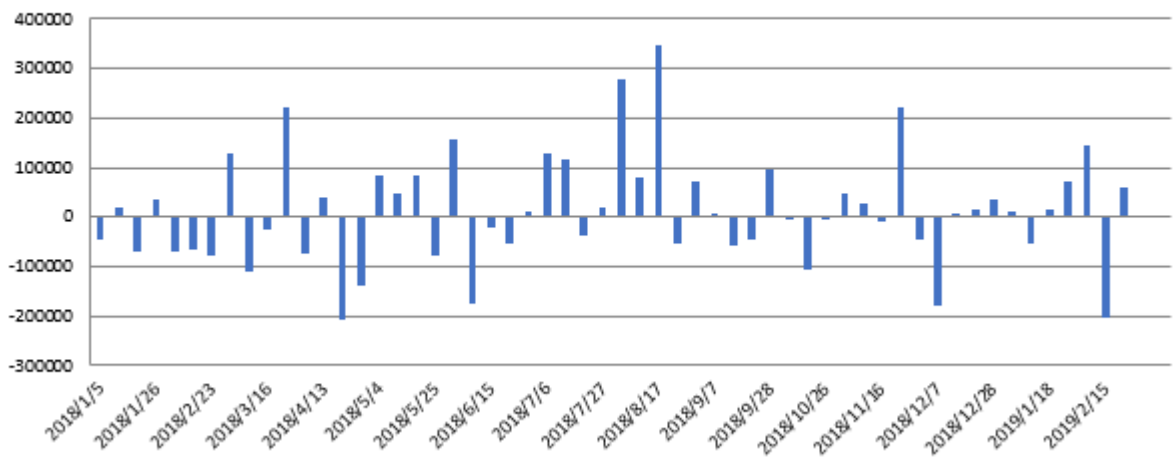
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
橡胶 1905	9	12625	12400		-20250	
焦炭 1905	4	2168	2143.5		-9800	
沪镍 1905	12	102930	101900		-12360	
沥青 1906	23	3306	3210		-22080	
白糖 1905						
累计盈亏					-44240	
收益率					-0.88%	

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。

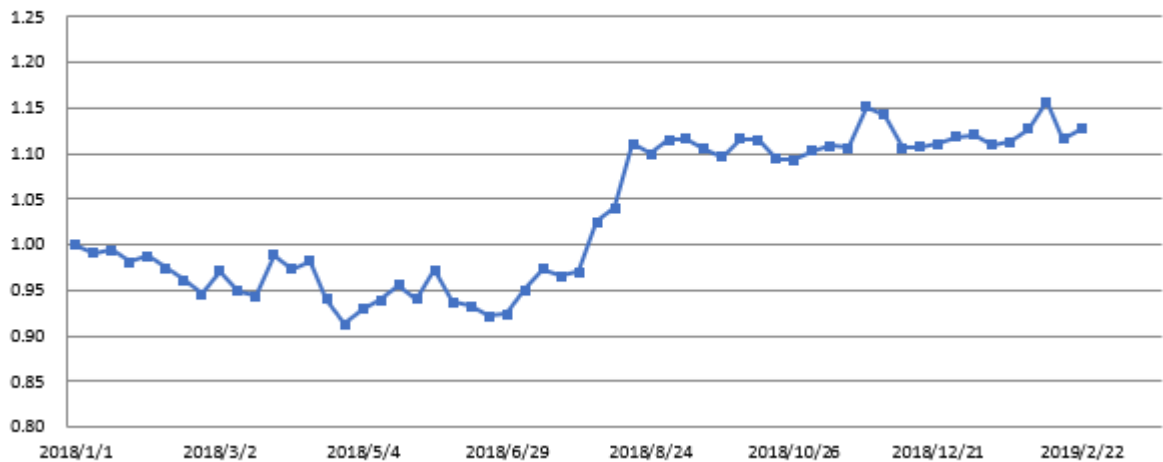
模拟盘平均开仓比例约为 15%，历史平均年化收益 23.7%，最大回撤 12%。

选品种详细参阅量化择时周报，每周商品热点跟踪。模拟盘组合按照总资金 2%止损。

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。