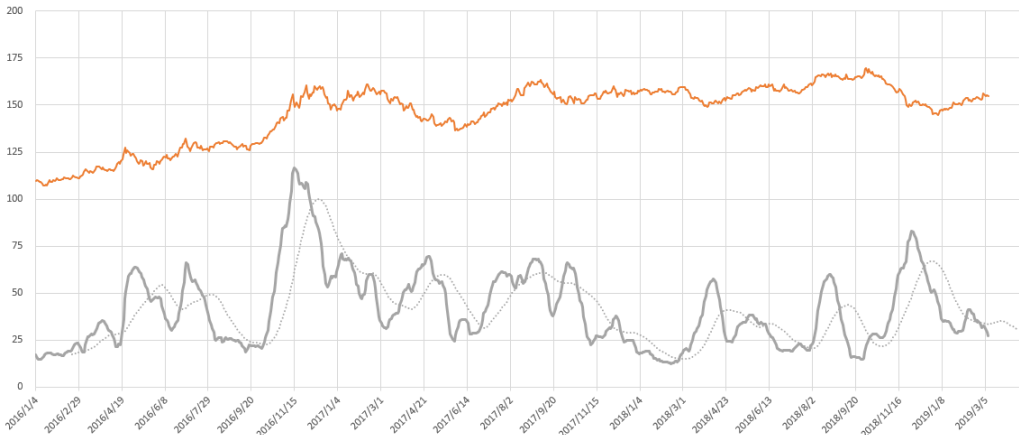


商品量化日报 CTA Daily Report

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
焦炭	0.73%	-7.66%
沪镍	-1.61%	-6.90%
PP	-1.26%	-6.46%
焦煤	0.46%	-4.94%
原油	0.39%	-4.35%
豆粕	0.63%	-3.70%
热卷	0.96%	-2.48%
豆油	-1.27%	-2.38%
动煤	-0.20%	-1.81%
沥青	-2.26%	-1.69%
螺纹	1.88%	-1.65%
玉米	0.88%	-1.26%
橡胶	-1.59%	-1.04%
沪铜	-0.44%	-0.60%
沪锌	-0.25%	-0.50%
PTA	-0.66%	-0.16%
沪银	-0.34%	-0.08%
沪铝	-0.15%	0.01%
铁矿	1.92%	0.20%
苹果	0.14%	0.96%
沪金	-0.46%	1.19%
白糖	-0.43%	1.20%
棕榈	-0.64%	1.31%
甲醇	-2.51%	1.41%
沪铅	0.32%	3.77%
棉花	0.87%	3.89%
燃油	-0.77%	6.45%
锰硅	1.09%	8.77%

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	建议观望 *
豆油	建议持多	铝	建议持多
豆粕	建议持空	锌	建议观望
白糖	建议观望 *	镍	建议持多
棉花	建议持多	白银	建议持空
焦炭	建议观望	橡胶	建议观望 *
动煤	建议持多	PTA	建议持多
螺纹	建议观望	PP	建议持多
铁矿	建议观望	沥青	建议持多
锰硅	建议持多	甲醇	建议持多
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（第十七期）：

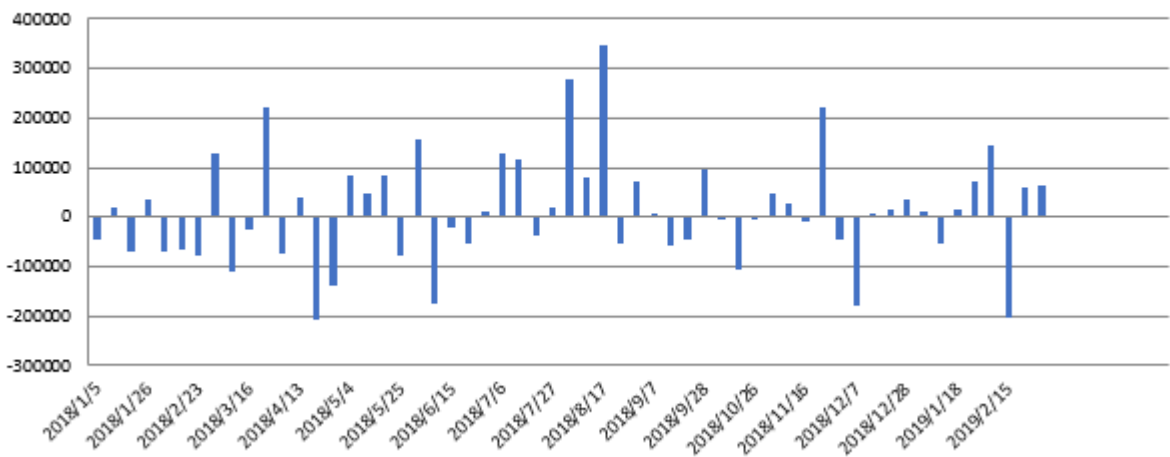
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
沥青 1906	23	3420	3292			
动煤 1905	30	620. 2	613. 2			
沪镍 1905	12	104690	104110			
橡胶 1905	9	12770	12215			
沪铜 1904	8	50530	49520			
累计盈亏			-100000			
收益率			-2. 00%			

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。

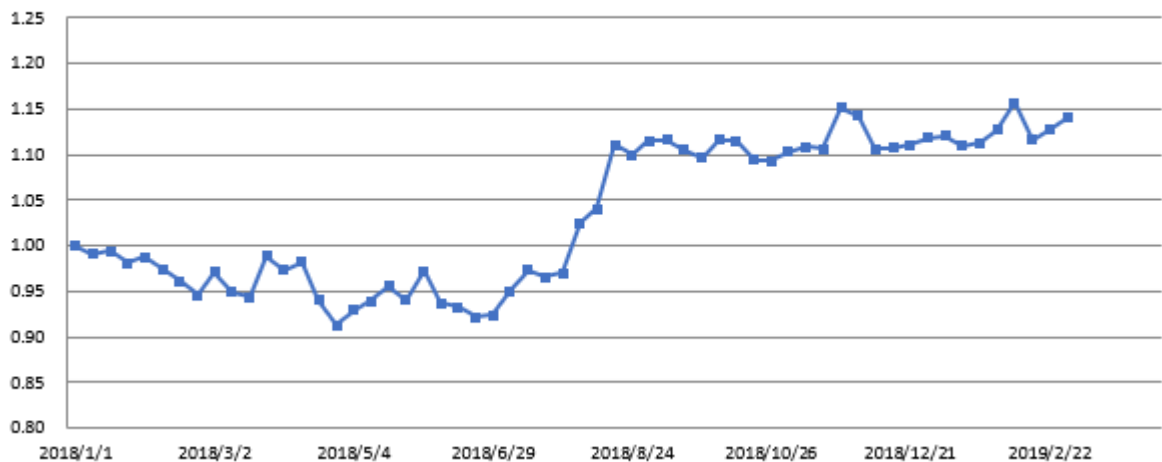
模拟盘平均开仓比例约为 15%，历史平均年化收益 23. 7%，最大回撤 12%。

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。