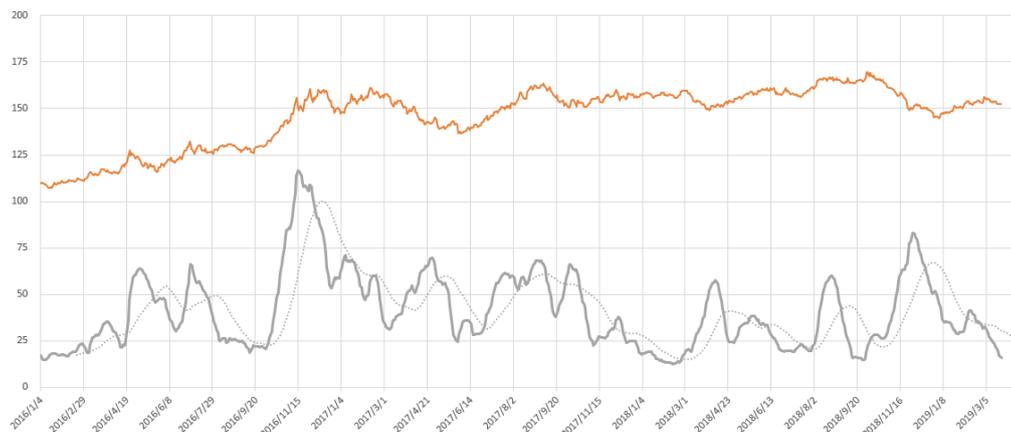


一. 商品指数走势:

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: 上海市自由贸易试验区

东育路 255 弄 5 号 29 层

	日涨跌	日持仓变动
甲醇	0.12%	-8.41%
锰硅	-0.03%	-5.29%
沪铅	0.65%	-5.21%
PTA	-0.06%	-2.75%
PP	0.75%	-2.56%
沥青	-0.77%	-1.50%
沪金	0.61%	-1.40%
豆粕	0.19%	-0.82%
燃油	1.33%	-0.77%
热卷	0.11%	-0.72%
棕榈	0.22%	-0.53%
苹果	-0.14%	-0.50%
焦煤	0.60%	-0.46%
螺纹	-0.08%	-0.31%
沪铝	0.11%	-0.28%
豆油	-0.11%	-0.11%
铁矿	0.42%	-0.09%
焦炭	0.18%	0.00%
橡胶	-0.08%	0.07%
白糖	-0.20%	0.56%
沪铜	0.43%	0.68%
沪镍	-0.38%	0.90%
棉花	-0.10%	1.34%
动煤	0.17%	1.47%
沪银	1.24%	1.87%
玉米	-0.32%	3.95%
沪锌	0.25%	4.84%
原油	1.22%	11.32%

三. 商品操作建议:

持仓周期 (中线)		持仓周期 (中线)	
玉米	建议持多	铜	建议观望
棕油	建议持空	铝	建议持多
豆粕	建议观望	锌	建议观望
白糖	建议观望	镍	建议观望
棉花	建议观望	白银	建议观望 *
焦炭	建议持空	橡胶	建议观望
动煤	建议观望	PTA	建议持空
螺纹	建议观望	PP	建议持空
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	建议观望		
IC	建议持多		

说明: 带“*”标注为当日操作变化, 2019/3/21日品种调整, 调出‘豆油’, 新增‘棕榈油’。

四、每周模拟盘展示 (第十九期):

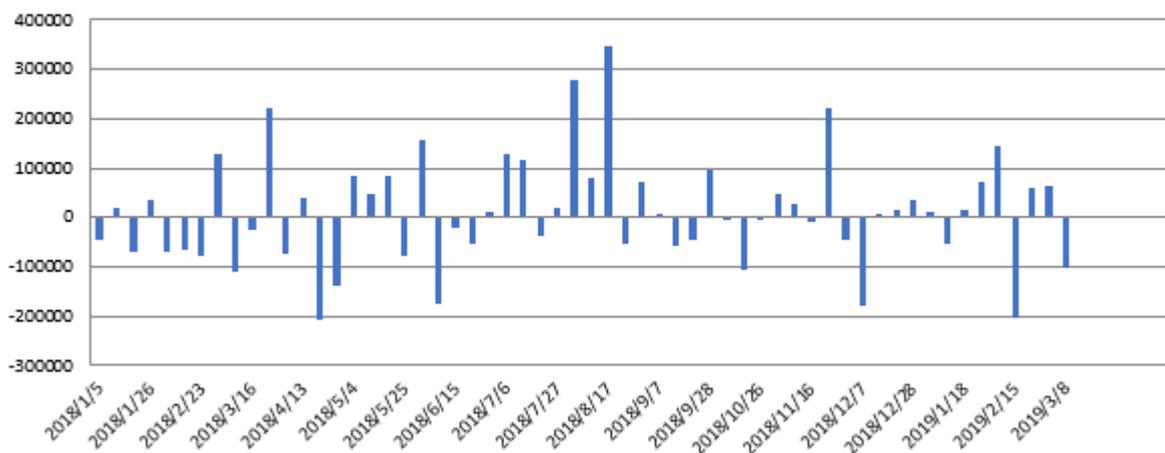
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
螺纹 1905						
沥青 1906	23	3378	3352		-5980	
沪镍 1905						
锰硅 1905	35	7804	7796		-1400	
白银 1906	-35	3595		3635		-21000
累计盈亏					-28380	
收益率					-0.57%	

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。