

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



中融汇信投资研究中心
中融汇信量化研究

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
焦炭	-1.71%	-5.02%
沥青	0.85%	-4.43%
锰硅	1.01%	-3.49%
沪铜	-0.23%	-1.88%
沪银	0.11%	-1.52%
棉花	-4.02%	-1.37%
沪镍	-0.03%	-0.72%
豆油	-0.04%	-0.40%
沪锌	-0.07%	-0.11%
沪铝	0.39%	0.23%
白糖	0.08%	0.29%
动煤	0.73%	0.31%
橡胶	0.97%	0.43%
甲醇	-1.30%	1.38%
棕榈	-0.68%	1.38%
玉米	1.14%	2.04%
焦煤	-0.77%	2.31%
PTA	-1.77%	2.36%
沪金	0.66%	2.69%
铁矿	-0.23%	3.18%
热卷	-1.80%	4.52%
燃油	1.67%	4.78%
螺纹	-1.35%	4.86%
豆粕	-0.04%	6.11%
沪铅	-1.15%	7.59%
PP	-1.18%	7.64%
苹果	2.08%	11.43%
原油	1.87%	11.56%

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

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 26 期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
PTA1909	-38	5886	5772		21660	
焦炭 1909	5	2165	2126.5		-19250	
沪锌 1907	-11	20815	20830		-825	
沪镍 1907	-11	96330	96370		-440	
锰硅 1909	-45	7162	7232		-15750	
累计盈亏					-14605	
收益率					-0.29%	

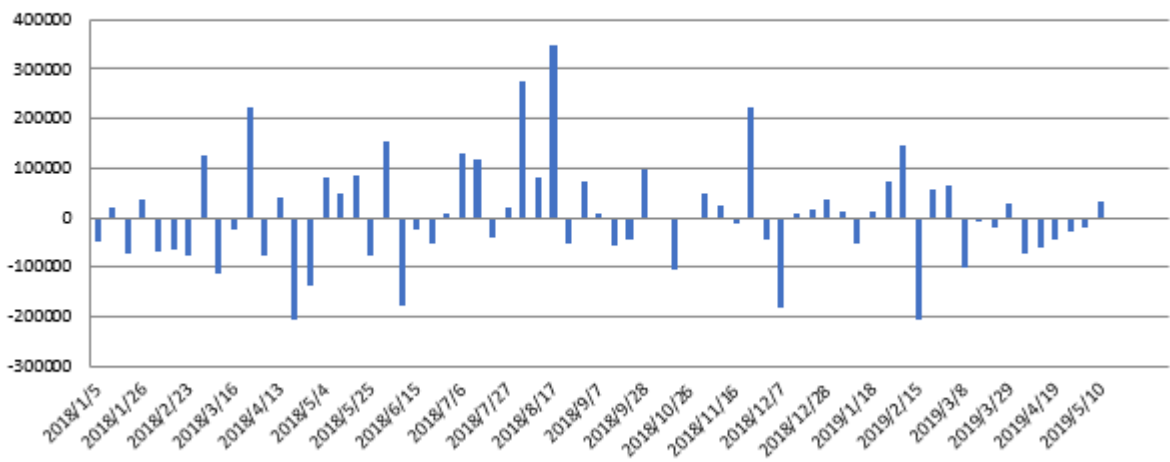
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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。

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。