

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
沪锌	-0.05%	-8.47%
焦炭	-0.53%	-7.85%
沪铝	-0.11%	-5.46%
原油	-2.91%	-4.94%
沪铅	0.12%	-4.36%
沪镍	-0.77%	-3.77%
甲醇	0.60%	-3.25%
沪银	0.25%	-2.35%
沪铜	0.35%	-2.06%
铁矿	1.78%	-1.76%
棉花	-0.51%	-1.66%
沪金	0.58%	-1.32%
PP	0.48%	-0.95%
豆油	-0.14%	-0.52%
豆粕	-0.95%	-0.50%
橡胶	0.71%	-0.46%
白糖	-0.14%	-0.36%
动煤	0.91%	-0.28%
热卷	0.42%	0.30%
焦煤	0.33%	0.93%
玉米	-0.25%	0.94%
棕榈	0.05%	1.50%
锰硅	-0.05%	1.60%
螺纹	0.66%	2.07%
苹果	-2.34%	3.35%
沥青	-1.63%	3.87%
PTA	1.49%	5.23%
燃油	-2.16%	11.98%

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	建议持空
棕油	建议持空	铝	建议持空
豆粕	建议持多	锌	建议持空
白糖	建议观望	镍	建议观望
棉花	建议观望	白银	建议持多
焦炭	建议持空	橡胶	建议观望
动煤	建议观望	PTA	建议观望 *
螺纹	建议观望	PP	建议持空
铁矿	建议持多	沥青	建议持空
锰硅	建议持多	甲醇	建议持空
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 32 期）：

品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
棉花 1909	-25	13455		13640		-23125
沥青 1912	-26	2952	2884		17680	
PTA1909	-38	5232		5406		-33060
豆粕 1909	72	2924	2939		10800	
沪铜 1908	-10	46310	46330		-1000	
累计盈亏			-28705			
收益率			-0.57%			

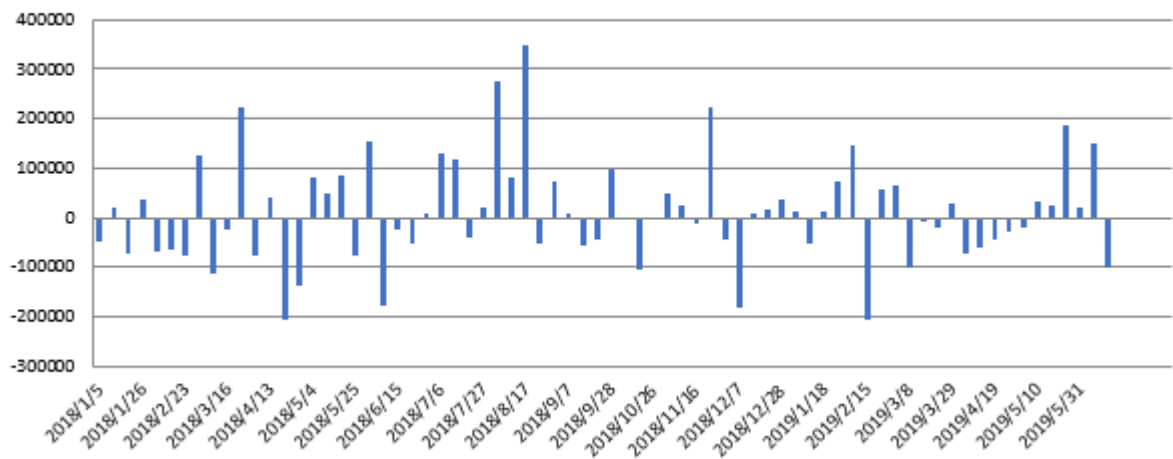
说明：模拟盘初始资金 500 万，每周选取 5 个市场热点品种，按照量化择时策略进行多空配置。

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。

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。