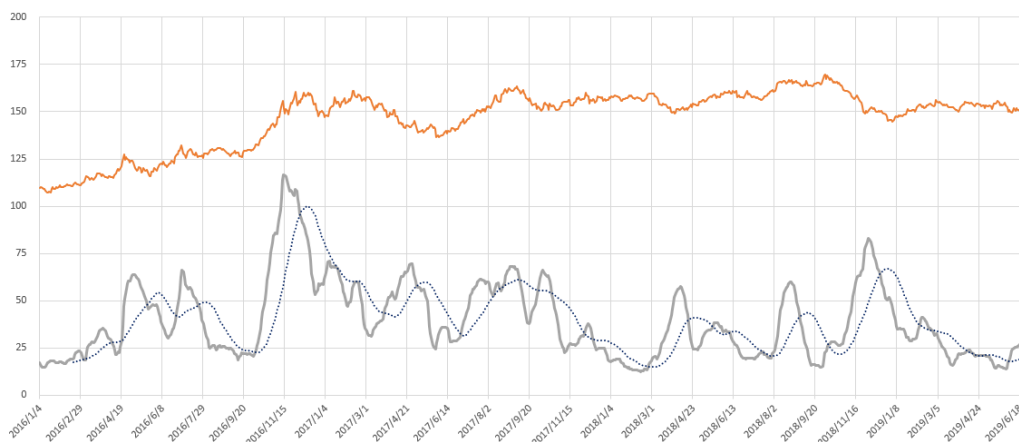


一. 商品指数走势:

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
燃油	2.42%	-16.57%
沪金	-0.52%	-5.29%
螺纹	0.98%	-3.93%
玉米	-0.51%	-3.40%
动煤	-0.17%	-3.32%
沪银	0.14%	-2.74%
沪铜	1.08%	-2.72%
热卷	1.37%	-2.56%
PP	1.54%	-2.29%
豆粕	-1.77%	-1.54%
豆油	-1.23%	-1.51%
原油	2.61%	-1.38%
沪锌	0.03%	-0.97%
沪铝	0.40%	-0.75%
沪镍	0.77%	-0.64%
苹果	0.21%	-0.62%
焦煤	0.32%	-0.37%
沥青	1.59%	-0.37%
棕榈	-0.23%	0.18%
锰硅	0.53%	0.23%
沪铅	0.65%	1.12%
橡胶	-0.87%	1.45%
PTA	2.98%	2.55%
白糖	0.55%	2.58%
棉花	3.20%	3.15%
铁矿	2.46%	3.80%
甲醇	0.42%	4.63%
焦炭	0.51%	12.65%

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	建议观望 *
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	建议观望 *
铁矿	建议持多	沥青	建议持空
锰硅	建议持多	甲醇	建议观望 *
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）：

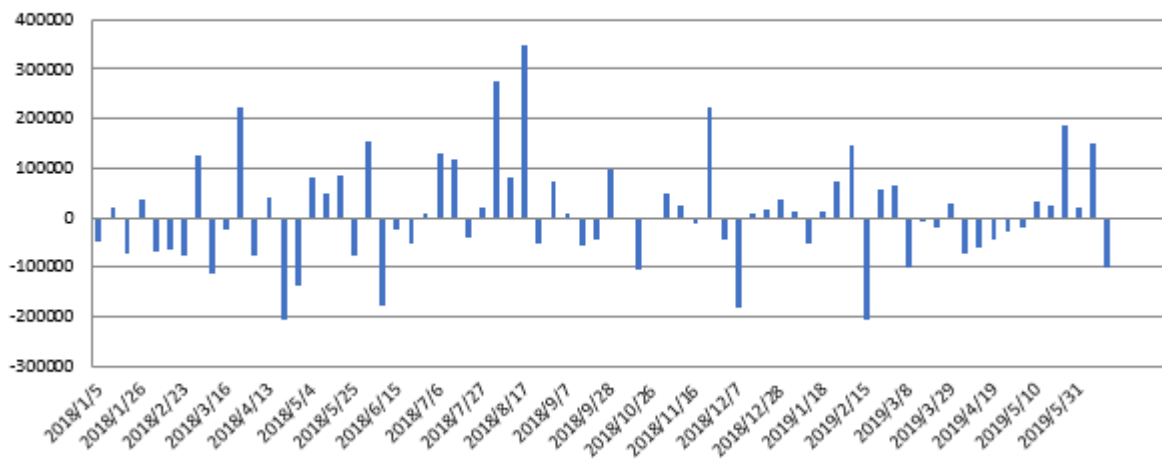
品种	手数	开仓价	最新价	平仓价	持仓盈亏	平仓盈亏
棉花 1909	-25	13455		13640		-23125
沥青 1912	-26	2952		2936		4160
PTA1909	-38	5232		5406		-33060
豆粕 1909	72	2924		2884		-28800
沪铜 1908	-10	46310		46690		-19000
累计盈亏					-100000	
收益率					-2.0%	

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。