

张利静 中国证券报·中证网

中证网讯（记者 张利静）12月18日，在华泰期货举办的“2022华泰期货衍生品策略年会”上，华泰期货研究院量化组总监何绪纲发布了升级后的华泰期货商品策略指数2.0版本。其主要亮点在于，增加了短周期动量指数（周频调仓）以及具有反转特征的偏度指数，对动量、期限结构进行补充，同时优化了指数的编制细节，并从板块分类、主力合约的判定规则、新品种上市纳入样本规则等方面进行全面升级和优化。

据悉，当日展示的华泰期货商品策略指数2.0是在2019年7月发布的华泰期货商品策略指数进行升级后的版本，目前已在Wind平台上正式发布。

“华泰期货商品策略指数2.0是更前瞻、更全面、更优化的“多因子商品策略指数体系”，它将商品指数的空间维度进一步拓展，华泰期货商品策略指数2.0有望成为未来商品投资领域中更坚固的基石。”何绪纲表示。