

交易周记

2017-02-25

内盘总结 22:11			
金属		黑色	
多-> 4	空-> 2	多-> 6	空-> 0
铜	铅	动力煤、矿、	
能化		农产	
多-> 4	空-> 4	多-> 6	空-> 5
沥青、	PP、PE、橡胶	玉米、淀粉、鸡蛋	大豆、油脂、白糖
贵金属	2:0 黄金>白银	股指	多头趋势、巨幅增仓、IH>IF>IC
缩量品种	锡、玻璃、PTA	国债	下跌趋势、小幅反弹
放量品种	螺纹钢、PE、大豆、油脂	逆回购	
持仓异常品种			
加仓		减仓	
动力煤、PE、油脂、白糖、鸡蛋		镍、玻璃、PTA、PVC	
关键点：			
1、有色延续之前走势、铜强、铅弱、持仓和成交量变化不大			
2、黑色系全部转入多头、动力煤大幅增仓放量向上、双焦也都转入多头			
3、能化多空参半、出现多个品种缩量、前期最强势品种橡胶破位下行、开始趋势转变看空			
4、农产品仍然玉米淀粉强势、大豆破位看空、油脂延续跌势、白糖出现巨幅增仓做空、整体看偏空			
库存异动			
库存大增		库存大减	
菜粕、		螺纹、PVC、PP、PE	
外盘总结			
美元指数	美元高位震荡、趋势不明朗	主要货币	跟随美元震荡

亚洲货币	RMB 盘整、港币开始走入空头、台币大幅升值	负利率区货币	跟随美元震荡
欧美期指	美股新高、欧股仍在多头震荡向上、俄罗斯进入空头、	亚洲期指	国企指数放量拉升、多头、A 股盘整
东京橡胶	橡胶进入空头、筑头完成	马来棕榈油	棕榈油大幅下跌、空头趋势加速
贵金属	贵金属反弹、增仓向上、黄金>白银	农产品	白糖破位下行、油脂破位下行、农产品大多数多头
有色	有色只有锡在空头、大多数都在多头、铝放出历史巨量	原油	原油盘整

关键点：

1、美元高位震荡、台币完全相反于台币、黄金出现大幅反弹、有可能美元要走弱

2、国企指数放量拉升进入多头、内盘判断将会跟涨、同时盯住 RMB 汇率变化

3、橡胶、油脂完全进入空头、呼应内盘走势、白糖破位下行、呼应内盘走势、有色大多处于多头、看空锡

股市板块总结

强势板块	超大盘、消费、医药、铝、锡、煤炭、钢材、	弱势板块	中小创、PP、农产品、白糖
大环境	盘整	成交量	缩量

关键点：

1、股票板块联动方面看多、铝、黑色系、看空白糖

2、整体环境缩量盘整、但是考虑到国企指数已经率先拉升、所以看多

思考：

商品方面

- 整体看多商品市场资金小幅流出、主力做多品种是黑色系、空头集中在农产品
- 有色方面：整体看多、铝最弱、铜最强
- 黑色系方面：全部转入多头、动力煤大幅增仓放量向上、同时前期的弱势品种双焦出现大幅反弹、建材业出现放量上涨
- 化工方面：开始走弱、前期最强品种橡胶跳空破位下跌进入空头、伴随其他多头的主动止赢盘、整体开始分化走弱、做空橡胶、PP
- 农产品方面：持续弱势、只有玉米、淀粉强势、油脂延续空头、白糖破位增仓破位下跌、鸡蛋判断错误可能变换成多头
- 贵金属有一定程度反弹、并且黄金于美元再次脱钩、黄金>白银
- 股市方面：看多 A 股、国企指数领先指标持续走强、IH>IF>IC

下周交易策略：

- 多：玉米、淀粉、动力煤
- 空：橡胶、油脂、白糖
- 股市：多 IH、多黄金

2/25/17

Futures (21:11) (多)

金属 铜 / 铝	黑色 铁矿
+ -	+ -
IF T (4:2)	IF (4:0)
建材 螺纹钢	化工 沥青 / PP, 塑料
+ -	+ -
T (2:0)	T (3:3)
农产 (玉米, 淀粉, 鸡蛋 / 油脂, 橡胶)	黄金 黄金
+ -	+ -
正 - 正 - (6:6)	T (2:0)

黑色系集体穿越均线, 有望价格企稳!

铜, 螺纹钢, 玉米, 铁矿 延续强势!

黄金突破向上! 鸡蛋突破向上!

PP, 塑料, PVC 显出疲态!

三大油脂继续看空.

国企指突破长期周期向上.

三大股指中, 大盘蓝筹IH最强! 继续看好大盘蓝筹.

本周 化工, 农产 弱势!

上周盘面表现, 电力股, 高压电股集体强势! 电力板块

暂时不再做农业股了!

桃李在杀跌中幸存, 有望走强!

新奥股份 黑色系 + 甲西亨 \Rightarrow 涨价行情

光伏/风电 板块集体强势,

核电仍弱势! \Rightarrow 保变电器, 拓日新能

关注: 新奥股份, 拓日新能
玉米 和 鸡蛋