

交易周记

2017-02-11

内盘总结 24:9			
金属		黑色	
多-> 4	空-> 2	多-> 6	空-> 0
铜	镍	动力煤、螺纹	
能化		农产	
多-> 6	空-> 2	多-> 6	空-> 5
玻璃、甲醇	PP	玉米、	油脂、白糖、鸡蛋
贵金属	2:0 黄金>白银	股指	IH>IF>IC、超大盘领导进入多头
缩量品种	锌、镍、PVC	国债	五年十年均出现小幅反弹、仍处于空头趋势
放量品种	铜、动力煤、螺纹、玻璃、油脂、白糖	逆回购	短期利率仍处于上升趋势
持仓异常品种			
加仓		减仓	
铜、铝、镍、动力煤、螺纹、甲醇、油脂、白糖		锌、PVC、PP、塑料	
关键点：			
1、有色走势出现分化、镍锡看空但是出现缩量减仓、铜铝成为多方主力、由于空方缩量减仓、多方放量增仓、目前看多			
2、市场风头再次导向动力煤、放量增仓向上突破、热卷<螺纹、			
3、化工品出现减仓回调、多头止盈明显、可能转向黑色系、最弱的是PP、塑料、最强的是甲醇、沥青、玻璃			
4、农产品普遍很弱、油脂、白糖放量增仓破位下行、空头趋势确立、多头只有玉米、鸡蛋也增仓破位			
库存异动			
库存大增		库存大减	
铜、铝、锌、		锡、热卷、淀粉、铁矿	

外盘总结			
美元指数	美元反弹、	主要货币	澳元大幅升值、加元大涨、
亚洲货币	RMB 高位盘整、亚洲区货币继续大涨、判断 RMB 成立多头	负利率区货币	日元瑞郎反向走势
欧美期指	美股大幅拉升、欧股进入多头、意大利股市较弱、	亚洲期指	国企指数大幅拉升、进入多头
东京橡胶	橡胶筑头明显、仍在多头回调区域	马来棕榈油	棕榈油空头
贵金属	贵金属反弹、黄金>白银	农产品	农产大多数多头、豆油走弱、
有色	有色处于多头、强势盘整、锡空头	原油	高位盘整
关键点：			
1、全球股市处于多头、风险情绪仍然乐观			
2、亚洲货币大幅升值、台币强势拉升、目前判断对 RMB 看涨			
3、豆油、棕榈油弱势拖累内盘、油脂全线走空、伦敦有色处于多头、看多沪铜			
股市板块总结			
强势板块	超大盘、消费、资源、军工、铜、纺织	弱势板块	PP、农产品、
大环境	全球看多、内盘反弹、商品互动	成交量	放量
关键点：			
1、放量拉升反弹、仍然以 IH 为代表的白马股行情			
2、农产品继续弱势			

思考：

商品方面

- 有色开始转换成多头、空平仓多加仓、铜最强、镍锡最弱、考虑到锡大幅库存减少、有色整体看多
- 黑色系再次成为吸金标的、动力煤反转、螺纹远远强于热卷
- 能化出现减仓走弱，有一定的筑头迹象、因为前期最强势品种橡胶确定筑头、同时伴随甲醇沥青的减仓、关注下方支撑位
- 农产品整体较弱、只有玉米和淀粉具有做多潜质、同时看到随着价格上涨淀粉库存下降、表明实体方面淀粉需求乐观、油脂白糖破位下行、配合农产品看空、适合做空
- 美元指数出现一定反弹、但是可以看到黄金跟涨、再次出现违反逻辑的走势、证明黄金的基本面发生改变、同时证明美元的涨势不够确立、盯住黄金走势

下周交易策略：

- 多：铜、玉米、淀粉
- 空：白糖、油脂
- 股市：多 IC、多黄金

2/11/2017

Futures (24:8)				Futures (24:8)			
金属	铜	黑色	铁矿	金属	铜	黑色	铁矿
+	-	+	-	+	-	+	-
正	- (6:0)	正	- (1:3)	正	- (6:0)	正	- (1:3)
建材	玻璃	化工	沥青/PP	建材	玻璃	化工	沥青/PP
+	-	+	-	+	-	+	-
正	- (2:0)	正	- (6:0)	正	- (2:0)	正	- (6:0)
农产	玉米, 胶, 油脂	贵金属		农产	玉米, 胶, 油脂	贵金属	
+	-	+	-	+	-	+	-
正	- (7:5)	正	- (2:0)	正	- (7:5)	正	- (2:0)

商品市场强烈看多

- ① 三大油脂 弱势, 黑色系偏弱
- ② 沥青 破位, 铁矿石 突破, 铜 突破
- ③ 新出现的机会 (玻璃)
- ④ 国企指突破 10000
- ⑤ 债券市场对加息持肯定态度
- ⑥ IF, IH 强于 IC (蓝筹强势)

- ① 核电板块 弱势, 仍不可操作
- ② 保变, 特变 强势, 易成新 解套, 高压板块有动作, 金风科技

桐昆股份 强势

- ③ 玻璃股果休突破 — 光耀玻璃
- ④ 沥青股突破 — 达刚路机, 同创高新
- ⑤ 铜股突破

对冲考虑黄金股 — 中金

近期行情还是商品涨价 — 周期股