

交易周记

2017-03-17

内盘总结 15:18			
金属		黑色	
多-> 4	空-> 2	多-> 5	空-> 1
锌	铅、镍	动力煤、	热卷
能化		农产	
多-> 1	空-> 7	多-> 3	空-> 8
PVC	玻璃、橡、塑料	玉米、淀粉	大豆、油脂、白糖
贵金属	2:0, 黄金>白银	股指	IF>IH>IC、股指盘整、本周 IF 表现强于 IC
缩量品种	玻璃、PVC	国债	弱势反弹、仍在长期跌势中、长端利率仍然看涨
放量品种	锌、镍、大豆、豆油、白糖	逆回购	短期利率多头
持仓异常品种			
加仓		减仓	
热卷、大豆、豆油、菜油、白糖		铝、锡、动力煤、塑料、棕榈油、玉米淀粉	
关键点：			
1、有色盘整、前期弱势品种反弹、强势品种回调、无明显趋势			
2、黑色系震荡、热卷弱势增仓破位下行			
3、能化方面全面进入空头、PVC 弱势反弹、仍然看空			
4、农产品全面看空只有玉米、淀粉强势、大豆暴跌、白糖放量增仓做空、油脂内部出现一定分化、棕榈油空头开始离场			
库存异动			
库存大增		库存大减	
铝、棉花		螺纹、热卷、甲醇、菜粕、大豆、豆油、PVC、PE、淀粉	
外盘总结			

美元指数	美元回调、	主要货币	主要货币震荡、
亚洲货币	RMB 盘整、港币大幅波动、台币大幅升值、	负利率区货币	小幅升值
欧美期指	美股盘整、欧股新高、	亚洲期指	国企指数新高、内盘盘整、
东京橡胶	延续空头	马来棕榈油	延续空头
贵金属	贵金属反弹	农产品	白糖放量增仓下跌、美豆进入空头、油脂继续空头、
有色	基本金属震荡	原油	原油回调
关键点：			
1、美元回调、亚洲货币小幅升值、主要货币震荡、台币大幅升值			
2、美股盘整、欧股新高、国企指数新高、A 股盘整			
3、白糖继续看空、油脂继续看空、橡胶继续空头			
股市板块总结			
强势板块	消费板块、中小板指大幅反弹、钢材、玻璃、塑料、饲料	弱势板块	大多数板块弱势、锌、锡、铁矿、农业股、白糖、
大环境	盘整	成交量	小幅放量
关键点：			
1、国企指数领先突破、内盘看多、目前震荡			
2、呼应商品板块的走势白糖、锡看空、同时玻璃、塑料和饲料开始反弹			

思考：

商品方面

- 总体分化走势、黑色系看多、能化和农产看空
- 有色方面：总体呈现反弹走势、但是仍然在偏空运行、目前最强的是锌、最弱的是铅和镍
- 黑色系发面：总体看多、动力煤是主力做多对象、热卷放量增仓破位下跌
- 能化方面：全面看空、主力做空对象为橡胶、塑料
- 农产方面：只有玉米和淀粉看多、油脂和白糖最弱、放量增仓破位下跌

股票方面

- 国企指数领先指数处在多头、IF>IH>IC、关注利率的提升打来的压力
- 关注美元指数和 RMB、目前美元走弱、看多黄金、如果 RMB 持续升值将会在短期内给予内盘极大的支持

下周交易策略：

- 多：玉米、淀粉、动力煤
- 空：橡胶、油脂、白糖
- 多：IF、多黄金、盯住美元

03/17/17

Futures
铜/铁

16:16

平

黑色

动力煤/焦煤

金属

+ -

正 -

5:1

+ -

IF

4:0

建材

螺纹钢/玻璃

+ -

- -

1:1

化工

沥青/PTA

+ -

T IF

2:4

农产品

玉米/豆粕/油脂+大豆

+ -

T 正正

2:10

贵金属

+ -

T

2:0

白糖突破向下，菜粕触碰到下方支撑位

白糖、郑棉均走弱

商品近入振荡走势

研究为什么白糖、棉有共性，
谁想通胀最敏感的。