

交易周记

2017-02-17

内盘总结 22:11			
金属		黑色	
多-> 5	空-> 1	多-> 4	空-> 2
铝	锡	矿、螺纹	双焦
能化		农产	
多-> 6	空-> 2	多-> 5	空-> 6
FG、沥青、甲醇	PP、塑料	玉米、淀粉	油脂：豆油<棕榈<菜油、白糖
贵金属	2:0 黄金>白银	股指	股指均进入多头、IH>IF>IC
缩量品种	沥青、PVC	国债	小幅反弹、仍在空头、长期利率仍在上升通道
放量品种	铝、动力煤、螺纹、FG、PP、塑料、油脂、玉米、白糖	逆回购	短期利率仍在上升通道
持仓异常品种			
加仓		减仓	
铝、动力煤、螺纹、FG、油脂、玉米、白糖、鸡蛋		锌、沥青、PVC、PP、塑料、大豆	
关键点：			
1、有色震荡、整体偏多、铝最强、锡最弱			
2、黑色系前期弱势品种放量反弹、前期强势品种继续强势、整体看多、动力煤、螺纹钢放量增仓上行、螺纹钢>热卷、双焦弱势			
3、化工开始分化、PP、塑料率先跌入空头、沥青出现塑料减仓、FG、沥青、甲醇仍然最强、PP、PE 最弱、橡胶正在筑头			
4、农产品整体偏弱、其中油脂继续为空头主要目标、白糖开始稳定增仓看空、玉米淀粉、巨量增仓做多			
库存异动			
库存大增		库存大减	

铅、		锡、热卷、甲醇、豆粕	
外盘总结			
美元指数	美元反弹、	主要货币	澳元强势、加元强势、
亚洲货币	RMB 盘整、	负利率区货币	日元、瑞郎盘整
欧美期指	美股新高、欧股震荡、意大利股市弱势、荷兰最强、加拿大强势	亚洲期指	国企指数向上突破、领先内盘大约两周、
东京橡胶	日本橡胶完成筑头、破位跳空向下	马来棕榈油	棕榈油进入空头、破位增仓跳空向下
贵金属	贵金属在多头、白银放量增仓>黄金震荡向上	农产品	大多数在多头只有白糖盘整、豆油破位向下、
有色	大多数在多头、其中锡在空头、铅弱势	原油	原油盘整
关键点：			
1、外汇方面震荡为主、延续之前判断不变、值得关注的是加拿大股票和外汇均很强势			
2、国企指数已经突破向上、这个指标领先大概两周有效的入场信息、做多IH			
3、橡胶、豆油和棕榈油确定进入空头、放量增仓跳空向下、强势空头、白银走势开始强于黄金			
股市板块总结			
强势板块	超大盘白马股、消费、铝、钢材、玻璃、PTA	弱势板块	有色、白糖股票
大环境	看多、领先指标已经突破	成交量	缩量
关键点：			
1、有色类股票有筑头的迹象、铝股票强势、			

2、农产品类股票开始走强
3、白糖股票破位向下、呼应期货白糖增仓向下

思考：

- 商品方面分化看多、总体以有色、能化主力多多头、农产品分化看空、资金呈现流入、商品仍然有许多期待
- 有色板块：铝最强、锡最弱、铅库存压力大、锡有可能下跌之路不顺畅
- 黑色系开始转入全部多头、前期弱势品种大幅反弹、前期强势品种延续强势、矿、螺纹为主力多头、双焦弱势
- 能化开始走弱、FG 最强、甲醇考虑库存大幅减少和甲醇股票板块的强势走势判断为短期回调、PP、PE 已经进入空头
- 农产品主要空头为主、玉米和淀粉巨量增仓看多、油脂全部看空、白糖增仓看空
- 贵金属方面外盘白银开始强于黄金、贵金属均处于多头、这种涨幅大多来自于美元的弱势带动黄金的拉升、短期市场行为、并没有明显迹象表明这是风险情绪的反应
- 股市方面、领先指标已经进入多头、同时三大股指已经震荡看多、排序:IH>IF>IC、同时全球股市大多处于多头、国内长短期利率均看涨、但这种看涨并不是由于通胀预期导致的、因为目前经济增速没有明显提升同时原油价格没有明显拉升、所以判断为央行调控收紧资金导致的市场看涨、原因未知、美元小幅回调但是仍然处于空头、

下周交易策略：

- 多：铝、螺纹、玉米、淀粉、
- 空：PP、PE、豆油、白糖
- 股市：多 IH、多黄金

2/17/2017

Futures (23:9) ② 黑色

金属			
+	-	+	-
正	-	T	T
建材	铁/铝	化工	矿/焦炭
+	-	+	-
T	② 螺纹钢	正	甲醇/PVC
农产品		黄金	
+	-	+	-
正	正	T	黄金
	玉米/三大油脂		

① 重点关注镍, 螺纹钢, 甲醇, 玉米做多
三大油脂做空

② 国企指看涨

③ IF, IH 看涨, IC 看跌空
④ 关注蓝筹回避创业板
股票池尽量选择中盘股

利率期货看空
加总预期仍在
利多投行股

人民币处于长期趋势线附近, 但仍看空

④ 上证仍在趋势线上方, 创业板弱

⑤ 农业龙头北大荒重回趋势线 重点关注!!

⑥ 券商股有动作, 明显放量

⑦ 恒丰纸业(强) 中广核电力有动作!

⑧ 新奥股份(甲醇对应股看好)

⑨ 重点关注黄金股

⑩ 核电和光伏暂时不行!