

交易周记

2017-03-04

内盘总结：			
金属		黑色	
多-> 3	空-> 3	多-> 5	空-> 1
铜	锌、铅、锡	动力煤、	热卷
能化		农产	
多-> 4	空-> 4	多-> 6	空-> 5
沥青	PP、PE、胶	玉米、淀粉	大豆、油脂、白糖
贵金属	2:0 减仓回调、多头止赢盘、白银弱于黄金	股指	缩量回调, IH>IF>IC
缩量品种	无明显缩量品种	国债	震荡下行、远期利率看涨
放量品种	铁矿、热卷、大豆	逆回购	短期利率震荡上行
持仓异常品种			
加仓		减仓	
锌、动力煤、热卷、大豆、菜粕、油脂、白糖		玉米、淀粉、白银	
关键点：			
1、有色整体回调、开始出现明显分化、铜最强、锌最弱			
2、黑色系整体开多、持仓大幅上升、动力煤最强、热卷最弱、热卷螺纹出现分化、螺纹>热卷			
3、化工出现明显回调走弱、甲醇回调进入空头、最强都头沥青业出现回调压线、整体开始看空			
4、农产品延续之前走势、玉米淀粉强势、大豆、油脂跳空向下、白糖巨幅增仓资金关注热情高涨、看空			
库存异动			
库存大增		库存大减	
铝、棉花、菜油、玻璃、		热卷、淀粉、豆油、聚乙烯、聚氯乙烯、	

外盘总结			
美元指数	美元小幅升值	主要货币	主要国货币小幅贬值
亚洲货币	RMB 震荡、港币进入贬值通道、	负利率区货币	震荡
欧美期指	美股盘整、欧股震荡向上、	亚洲期指	国企指数回调仍在多头、三大股指盘整、
东京橡胶	橡胶进入空头	马来棕榈油	棕榈油仍在空头
贵金属	小幅减仓回调	农产品	白糖破位向下、油脂大幅反弹、农产处于多头、
有色	基本金属中锡、锌最弱、其他均处于多头	原油	盘整
关键点：			
1、美元近期表现震荡、港币进入贬值通道考虑是否影响 RMB			
2、负利率区货币较为稳定无明显趋势			
3、白糖破位向下、油脂大幅反弹、橡胶进入空头、农产品板块的趋势还在延续			
股市板块总结			
强势板块	大盘股、化工板块、油脂、	弱势板块	有色板块回调、农产品、白糖、
大环境	缩量盘整	成交量	缩量
关键点：			
1、股市缩量盘整、国企指数领先指标仍然看多、趋势仍然集中在白马股			
2、有色板块出现回调、结合商品市场出现回调、有可能出现阶段性行情			
3、白糖板块进入空头、加上美商品白糖已经进入空头、白糖目前持仓历史新高、可能爆发空头行情			

思考：

商品方面

- 整体来看商品市场资金净流入增大、总体持仓达到新高、趋势看阶段性回调
- 有色方面：呈现持仓上升回调、总体开始走弱、有可能出现阶段性空头行情
- 黑色系方面：基本全部多头、螺纹钢>热卷、前期疲软的动力煤疯狂加仓放量做多、成为多头新宠儿、总体黑色看多
- 化工方面：多空参半、总体开始走弱、资金呈现净流出、前期强势品种橡胶正式进入空头、连带作用下整体回调甚至看空
- 农产品方面：延续之前的走势分化严重、玉米淀粉看多、油脂白糖看空
- 贵金属方面已经连续数周与美元脱节、目前可以判断为黄金的阶段性底部、看震荡、加上美元近期盘整预计黄金偏多运行

股市方面

- 领先指标下国企指数仍然看多、内盘股票震荡看多
- 板块方面近期走势与商品方面走势配合良好
- 白马股仍然是行情的主流、回避创业板

下周交易策略：

- 多：动力煤、玉米、淀粉
- 空：锡、橡胶、油脂、白糖
- 股票：多 IH，多黄金

3/4/17

Futures (22:10) (多)

金属 铜/锡

黑色

郑煤

十 一
正 下

十 一
正 下

建材 螺纹钢

化工 沥青/PP, 塑料

十 一
下 下

十 一
下 下

农产 玉米, 淀粉/大豆

贵金属 白银

十 一
正 下

十 一
下 下

黑色系

新强势品种: 郑煤, 玉米, 淀粉,

品种: 白银

弱势破位品种: 大豆

三大油类继续看空。

上证向下跳空, 收下影线十字星, 由于美股下跌导致

罗牛山尾盘放量拉升(?)

保变电器进入交易区间

核电板块仍不行

中广核电力

鸡蛋减仓强势

农业龙头, 北大荒弱势

楚江新材(?)

国企指高位回调, 仍在多方市场

本周IC较强, 债券市场看空