



华鑫期货每日晨报

2023年10月13日

内容:

- 华鑫早间头条
- 今日提示
- 夜盘动向
- 策略参考

宏观与产业

1, 长江经济带

国家领导人强调，进一步推动长江经济带高质量发展，更好支撑和服务中国式现代化。要协同推进降碳、减污、扩绿、增长，把产业绿色转型升级作为重中之重，加快培育壮大绿色低碳产业，积极发展绿色技术、绿色产品，提高经济绿色化程度，增强发展潜力和后劲。大力推动产业链供应链现代化，接续实施增强制造业核心竞争力行动，培育壮大先进制造业，加快发展战略性新兴产业和未来产业，促进数字经济和实体经济深度融合。

2, 昨日央行逆回购操作

央行周四开展1620亿元7天期逆回购操作，中标利率为1.80%，当日有5080亿元逆回购到期，因此实现净回笼3460亿元。

3美国9月CPI涨幅超预期,

数据显示，美国9月未季调CPI同比上升3.7%，预期3.6%，前值3.7%；季调后CPI环比升0.4%，预期0.3%，前值0.6%。剔除波动较大的食品和能源价格后，美国9月核心CPI同比上升4.1%，符合预期，前值4.3%；环比升0.3%，与预期及前值一致。

4, 美联储官员发声

柯林斯：不排除进一步紧缩的可能性；国债收益率上升强化了美联储处于或接近利率峰值的观点；9月份CPI数据显示物价恢复稳定需要时间；现在说通胀率正在可持续地往2%的目标回落还为时过早；看到劳动力市场再平衡的迹象；对经济可以摆脱衰退保持乐观。

5, 欧洲央行9月货币政策会议纪要显示

绝大多数成员支持将利率上调25个基点，一些成员倾向于将利率维持在当前水平，加息和暂停加息之间决策非常艰难。

资本市场

1, 昨国内股市

中央汇金增持四大行股份，大金融扛起领涨大旗，上证指数收复3100点。盘面上，保险、银行板块表现亮眼，锂矿概念爆发多股涨停，油气股回调。上证指数收涨0.94%，报3107.90点，深证成指涨0.83%，创业板指涨0.76%，科创50指数涨0.73%，上证50涨0.94%，北证50涨0.19%，万得全A涨



0.81%，万得双创涨0.46%。A股成交额为8319.4亿元，北向资金净买入66.16亿元，结束连续4日净卖出，比亚迪获净买入5.18亿元居首，赛力斯遭净卖出2.29亿元最多。

香港恒生指数放量收涨1.93%，报18238.21点，恒生科技指数涨1.68%收复4000点，恒生国企指数涨2.19%。内银股、内险股大涨，建设银行、中国光大控股、中国太保涨超5%；医药股持续强势，和黄医药涨超6%；新股十月稻田上市首日收涨22%。大市全日成交1011亿港元，南向资金净卖出54.83亿港元，结束连续7日净买入，盈富基金遭净卖出27.03亿港元居首，药明生物获净买入3.51亿港元最多。中国台湾加权指数收涨0.92%，报16825.91点。

2, 隔夜美股、美债和美元

美国三大股指全线收跌，道指跌0.51%报33631.14点，标普500指数跌0.62%报4349.61点，纳指跌0.63%报13574.22点，美股终结四连阳。波音跌2.44%，麦当劳跌1.89%，领跌道指。万得美国TAMAMA科技指数跌0.26%，特斯拉跌1.57%，谷歌跌1.12%。中概股普遍下跌，达达集团跌8.37%，京东跌8.27%。

美债收益率集体收涨，2年期美债收益率涨8.6个基点报5.077%，3年期美债收益率涨10.2个基点报4.853%，5年期美债收益率涨12.4个基点报4.702%，10年期美债收益率涨14.7个基点报4.704%，30年期美债收益率涨16.8个基点报4.861%。

纽约尾盘，美元指数涨0.82%报106.58，非美货币普遍下跌，欧元兑美元跌0.85%报1.0529，英镑兑美元跌1.14%报1.2174，澳元兑美元跌1.56%报0.6314，美元兑日元涨0.43%报149.81，美元兑瑞郎涨0.71%报0.9084，离岸人民币对美元跌81个基点报7.3098。

■ 今日提示

09:30 中国9月CPI年率

10:00 中国9月贸易帐

■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

商品相关信息：

原油：欧佩克维持全球石油需求相对强劲的预期。欧佩克月报将今年全球经济增长预测上调至2.8%，将明年预测维持在2.6%不变；将今年全球原油需求增速预期维持在244万桶/日不变，预计明年增速为225万桶/日。月报显示，受尼日利亚、沙特和科威特增产推动，9月欧佩克原油产量增加27.3万桶/日，达到2775万桶/日。欧佩克预计，今年第四季度全球石油库存每天将减少约300万桶，如果成为



现实，将是近30年来最大数据缺口。IEA发布月报，预计今年全球石油需求增速为230万桶/日，得益于中国、印度和巴西需求增长。IEA将明年全球石油需求增长预测下调至88万桶/日，主因经济环境疲软和能源效率提高。美国上周EIA原油库存增加1017.6万桶，预期增加49.2万桶，前值减少222.4万桶。

动力煤：郑商所表示，经研究决定，动力煤期货2410合约交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易最大数量为20手。

2, 夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘多数上涨，能源化工品普遍上涨，低硫燃料油涨2.03%，丁二烯橡胶涨1.95%，苯乙烯涨1.3%，燃油涨1.1%。黑色系多数下跌，焦炭跌1.12%。农产品多数上涨，菜油涨1.55%。基本金属涨跌不一，沪镍涨0.95%，不锈钢涨0.71%，沪锡涨0.2%，沪铝跌0.34%，沪铜跌0.46%，沪锌跌0.71%，沪铅跌0.82%。

策略参考和回顾

昨日回顾：

股指：

昨日盘后政策出台诸多利好，如汇金增持四大行、普惠金融政策、资本市场支持高科技领域等，市场处于政策底后构筑市场底阶段，该阶段比预期略长，等待成交放量的确认。四季度股市具备配置优势。

商品：

商品整体仍处于原油带动下的调整阶段，节后大跌后进入震荡，部分前期冷门的商品，如橡胶、碳酸锂等在增量资金作用下，渐入活跃，可少量参与。

今日建议：

股指：

昨日股市在个汇金增持四大行利多的带动下，呈整体上扬。国内股市目前处于低估值、宏观回暖和政策利好共振，政策底后，市场底逐步形成阶段，维持四季度，寻机配置股指的观点，而IM和IC具备较大的价格弹性。关注今天早上国内CPI和贸易数据。

商品：

商品尚未整体走出原油调整带来的压力，但部分商品由于热钱资金的涌入出现了活跃，比如昨日提示的碳酸锂和橡胶等，可适量参与，橡胶近期大涨主因是主产区受灾和国内需求数据预期回升，但需要注意现货短的贴水对期价的压力，而碳酸锂在连续大跌后反弹，市场对消费增长有所预期，近期期价和相关上市公司如锂矿、新能源汽车等有联动，值得关注。

注意事项

本文中的信息均来源于公开资料，华鑫期货研究所及相关研究人员力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。我们已力求文章内容客观、公正，但文章中的信息与所表达的观点不构成所述期货买卖的出价或询价的依据，该等信息、意见并未考虑到获取本文人员的具体投资目的、财务状况以及特定需求，在任何时候均不构成对任何人的个人推荐。对依据或者使用本文所造成的一切后果，华鑫期货及其关联人员均不承担任何法律责任。

本文中的资料、意见、预测均只反映文章初次发布时的判断，可能会随时调整。该等意见、评估及预测无需通知即可随时更改。华鑫期货没有将此意见及建议向文章所有接收者进行更新的义务。本文仅供内部参考交流使用，不构成投资建议。如未经授权，私自转载或者转发本文，所引起的一切后果及法律责任由私自转载或转发者承担。华鑫期货将保留随时追究其法律责任的权利。

华鑫期货有限公司

地址：上海市黄浦区福州路666号21、22楼

邮编：200001

电话：400-186-8822

华鑫期评

