



华鑫期货每日晨报

2023年10月24日

内容:

- 华鑫早间头条
- 今日提示
- 夜盘动向
- 策略参考



■ 华鑫早间头条:

宏观与产业

1, “国家队”重磅官宣入市

中央汇金公司10月23日买入交易型开放式指数基金（ETF），并将在未来继续增持。当日沪深300ETF易方达（510310）尾盘出现异动，成交量迅速放大。此前，中央汇金公司已出手增持国有四大行A股股份，金额合计约4.77亿元。分析指出，中央汇金公司相当于半个“平准基金”，此刻增持有利于市场信心恢复。2015年股市大幅波动时，中央汇金公司曾入市救场，在二级市场买入ETF。

2, 全国累计发电装机容量高速增长

国家能源局发布数据显示，截至9月底，全国累计发电装机容量约27.9亿千瓦，同比增长12.3%。其中，太阳能发电装机容量约5.2亿千瓦，增长45.3%；风电装机容量约4.0亿千瓦，增长15.1%。

3, 第六届进博会将于11月5日至10日在上海全面线下举办

国新办举行新闻发布会，介绍第六届中国国际进口博览会筹备情况。据介绍，第六届进博会将于11月5日至10日在上海全面线下举办。商务部表示，将与有关部门一道，多措并举促进全球优质产品进口。会同有关部门修订《鼓励进口技术和产品目录》，支持企业扩大先进技术、重要装备和关键零部件进口，促进产业结构调整和优化升级。发挥跨境电商零售进口积极作用，继续释放消费品进口潜力。

资本市场

1, 昨日国内股市

A股持续大幅调整，三大指数均跌超1%。盘面上，芯片股大幅下跌，新能源赛道股表现低迷，卫星导航、5.5G概念股逆势走强。上证指数收跌1.47%，报2939.29点，深证成指跌1.51%，创业板指跌1.69%，科创50指数跌2.51%，深证50跌0.69%，上证50跌0.81%，北证50跌2.77%，万得全A跌1.74%，万得双创跌2.32%。A股成交额降至7218亿元。港股因假期休市一日，北向、南向资金均暂停交易。中国台湾加权指数收跌1.15%，报16251.36点。

2, 昨日美股、美债与汇率



美国三大股指收盘涨跌不一，道指跌0.58%报32936.41点，标普500指数跌0.17%报4217.04点，纳指涨0.27%报13018.33点。道指和标普500指数连跌四日。美国10年期国债收益率突破5%之后回落。雪佛龙跌3.7%，英特尔跌3.06%，安进跌2.06%，领跌道指。万得美国TAMAMA科技指数涨0.95%，英伟达涨3.84%，ARM涨4.89%。双方透露正共同开发适用于Windows系统的PC芯片。英伟达主要竞争对手英特尔则收跌逾3%。

2年期美债收益率跌2.6个基点报5.06%，3年期美债收益率跌5.1个基点报4.871%，5年期美债收益率跌6.5个基点报4.802%，10年期美债收益率跌6.6个基点报4.849%，30年期美债收益率跌8.1个基点报5.001%。盘中10年期美债收益率一度突破5%，最高上涨至5.024%，创16年来新高。

纽约尾盘，美元指数跌0.53%报105.5977，非美货币集体上涨，欧元兑美元涨0.71%报1.067，英镑兑美元涨0.7%报1.225，澳元兑美元涨0.33%报0.6335，美元兑日元跌0.09%报149.713，美元兑加元跌0.21%报1.3691，美元兑瑞郎跌0.13%报0.8911，离岸人民币兑美元涨183个基点报7.3103。

■ 今日提示

16:40 [欧元区10月制造业、服务业PMI初值](#)

21:45 [美国10月Markit制造业、服务业PMI初值](#)

■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

1, 商品相关信息:

国务院关税税则委员会根据商务部建议作出决定，自10月24日起，对原产于韩国、泰国和马来西亚的进口共聚聚甲醛继续征收反倾销税，实施期限为5年。

农业农村部表示，今年我国粮食产量有望再创历史新高，连续9年保持在1.3万亿斤以上；大豆面积连续2年稳定在1.5亿亩以上。我国生猪后市供应将稳定增加，四季度是消费旺季，猪价可能会回升，但缺乏大幅上涨基础。

2, 夜盘动向：（按昨日结算价）

国内期货夜盘收盘涨跌不一，LPG涨1.70%，苯乙烯涨1.48%、沥青涨1.43%、乙二醇涨1.11%。豆二、豆一跌近1%。基本金属收盘涨跌不一，沪铜涨0.5%，沪锌涨0.48%，不锈钢涨0.41%，沪铝持平，沪铅跌0.48%，沪锡跌0.55%，沪镍跌1.67%。



策略参考和回顾

1, 金融

市场从10月初的阴跌到加速恐慌杀跌，短期跌势进入尾声阶段，报复性反弹随时可能出现，后续关注量能是否能放大，目前大批蓝筹具备估值上的配置优势。昨晚汇金公告买入交易型开放式指数基金，并称将在未来继续增持，这些利于未定大蓝筹的稳定，但长期而言，国内资本市场也亟需弥补制度上的缺陷甚至漏洞，才能根本扭转投资者信心。近期关注IH和IF稳定后，IM是否能增加弹性。

2, 商品

昨日商品市场与股市联动，市场整体低迷。关注今日股市对工业品盘中的影响，以黑色系为例，螺卷向下破位，但目前钢厂利润亏损较大，不宜对下方空间有较大的预期，而矿石和焦煤，现货升水偏高，中期做空的性价比偏低，宜维持震荡思路，盘中短线。因巴以冲突，原油和黄金成为焦点，但临近前期高点，注意回撤风险。昨日生猪盘中有所异动，远期有资金介入，市场焦点于近期主产区的猪瘟对未来供给的影响，可以关注。



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

