



华鑫期货每日晨报

2023年10月30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, 中央汇金公司资金持续涌入ETF

中央汇金公司宣布买入ETF后, 资金持续涌入ETF。数据显示, 在10月23日至10月27日的一周内, A股ETF净流入资金154亿元。沪深300、科创板和创业板相关ETF是资金流入最多的标的, 非银金融、芯片相关ETF也获资金追捧。

2, 融券保证金比例由不得低于50%上调至80%

融券新规今日开始施行。10月14日, 证监会调整优化了融券相关制度, 将融券保证金比例由不得低于50%上调至80%, 对私募的这一比例上调到100%。随后, 交易所也发布了《关于优化融券交易和转融通证券出借交易相关安排的通知》。通知称, 新规实施前尚未了结的融券合约, 融券保证金比例要求仍按照原规定执行。上述规定自2023年10月30日起施行。

资本市场

1, 上周五国内股市

A股大幅反弹, 上证指数重返3000点。盘面上, 医药板块爆发, 多股涨停; 新能源赛道回暖, 消费股走强。个股方面, 北交所新股阿为特上市首日大涨1008.33%。上证指数收涨0.99%报3017.78点, 周涨1.16%; 深证成指涨2.14%, 周涨2.09%; 创业板指涨2.88%, 周涨1.74%; 科创50涨1.48%, 周线持平; 上证50涨0.88%, 周涨1.08%; 深证50涨2.18%, 周涨2.66%; 北证50涨3.98%, 周涨4.19%; 万得全A涨1.45%, 周涨2.01%; 万得双创涨1.93%, 周涨2.18%。A股成交额为9661.1亿元, 创近2个月新高。北向资金净买入46.68亿元, 天齐锂业获净买入5.27亿元居首, 山西汾酒遭净卖出4.16亿元最多。

香港恒生指数收涨2.08%报17398.73点, 周涨1.32%; 恒生科技指数涨2.52%, 周涨3.93%; 恒生国企指数涨2.04%, 周涨1.83%。医药股爆发, 翰森制药涨近12%, 地产、科技、大消费联袂走强。大市成交914.78亿港元, 南向资金净买入24.11亿港元, 美团获净买入2.62亿港元居首, 中国移动遭净卖出1.81亿港元最多。中国台湾加权指数收涨0.38%, 报16134.61点, 周跌1.86%, 连跌两周。

2, 上周五美股、美债与汇率



美国三大股指收盘涨跌不一，道指跌1.12%报32417.59点，标普500指数跌0.48%报4117.37点，纳指涨0.38%报12643.01点。雪佛龙跌6.71%，摩根大通跌3.63%，领跌道指。万得美国TAMAMA科技指数涨1.46%，亚马逊涨6.83%，特斯拉涨0.75%。中概股涨跌互现，比特小鹿涨18.5%，盛美半导体跌21.92%。本周，道指跌2.14%，标普500指数跌2.53%，纳指跌2.62%。

美债收益率多数收跌，2年期美债收益率跌4.6个基点报5%，3年期美债收益率跌6.8个基点报4.815%，5年期美债收益率跌5个基点报4.753%，10年期美债收益率跌1.4个基点报4.834%，30年期美债收益率涨1.9个基点报5.007%。

纽约尾盘，美元指数跌0.03%报106.579，周涨0.4%。非美货币涨跌不一，欧元兑美元涨0.02%报1.0564，周跌0.29%；英镑兑美元跌0.05%报1.212，周跌0.3699%；澳元兑美元涨0.21%报0.6335，周涨0.33%；美元兑日元跌0.51%报149.648，周跌0.13%；美元兑加元涨0.31%报1.3875，周涨1.13%；美元兑瑞郎涨0.43%报0.9027，周涨1.17%；离岸人民币对美元跌92个基点报7.3337，本周累计跌51个基点。

■ 今日提示

18:00 欧元区10月工业景气指数与经济景气指数

■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

1, 商品相关信息:

乌克兰国家石油天然气公司负责人切尔尼绍夫表示，将于2024年底停止俄罗斯天然气经由乌克兰过境运输。

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，苯乙烯涨2.56%，LPG涨1.18%，聚丙烯涨1.07%，橡胶跌2.58%，20号胶跌2.05%。黑色系全线上涨，铁矿石涨1.94%，焦煤涨1.37%。农产品多数上涨，豆粕涨1.2%，豆二涨近1%。基本金属集体收涨，沪锌涨1.43%，沪铝涨1.43%，沪锡涨1.05%，沪铜涨0.89%，不锈钢涨0.79%，沪镍涨0.71%，沪铅涨0.59%。

■ 策略参考和回顾

1, 金融



回调中线买入远期IM。

2, 商品

回调中线买入高基差工业品，如焦煤、矿石、纯碱、玻璃等，长线配置黄金作为对冲风险的手段，或者紧盯经济边际好转对其他商品的传导，如有色中的铜铝、贵金属中的白银，化工中沥青等。农产品中，关注粕类的基差修复行情，以及近期国内主产区发生的非洲猪瘟，对远期生猪价格可能产生的影响。



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

