



华鑫期货每日晨报

2023年11月1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, 中央金融工作会议在北京举行要求着力营造良好的货币金融环境

中央金融工作会议在北京举行。会议指出,要着力营造良好的货币金融环境,切实加强对重大战略、重点领域和薄弱环节的优质金融服务。优化融资结构,更好发挥资本市场枢纽功能,推动股票发行注册制走深走实,发展多元化股权融资,大力提高上市公司质量。支持国有大型金融机构做优做强,严格中小金融机构准入标准和监管要求。切实提高金融监管有效性,依法将所有金融活动全部纳入监管。建立防范化解地方债务风险长效机制。维护金融市场稳健运行,规范金融市场发行和交易行为,合理引导预期。保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。

2, 中国10月官方制造业PMI为49.5

中国10月官方制造业PMI为49.5,比上月下降0.7个百分点,降至收缩区间,制造业景气水平有所回落。非制造业PMI为50.6,前值51.7。综合PMI为50.7,比上月下降1.3个百分点,表明我国企业生产经营活动总体扩张,但扩张速度放缓。

资本市场

1, 昨日国内股市

A股弱势整理,科技类题材普遍回调,地产、光刻机板块午后崛起。截至收盘,上证指数跌0.09%报3018.77点,深证成指跌0.65%,创业板指跌0.48%,科创50指数跌0.42%,北证50跌0.97%,万得全A跌0.4%,万得双创跌0.54%。市场成交额9194.2亿元;北向资金净卖出47.53亿元,比亚迪遭大额净卖出近8亿元,兴业银行遭减仓6.69亿元。10月,上证指数累计跌2.95%,深成指跌2.43%,创业板指跌1.78%。北向资金10月累计净卖出近450亿元,2015年以来首次连续3月减仓。

恒生指数低开低走收跌1.69%,报17112.48点,10月累跌3.91%;恒生科技指数跌2.47%,10月累跌4.12%;国企指数跌1.65%,10月累跌4.66%。汽车、消费电子跌幅居前,零跑汽车跌超15%,比亚迪电子跌超10%。全日大市成交缩量至847亿港元,南向资金净买入19.35亿港元。中国台湾加权指数收跌0.92%。

2, 昨日美股、美债与汇率

美国三大股指全线收涨,道指涨0.38%报33052.87点,标普500指数涨0.65%报4193.8点,纳指涨0.48%报12851.24点。波音涨2.46%,英特尔涨2.27%,领涨道指。万得美国TAMAMA科技指数涨0.1%,



特斯拉涨1.76%，亚马逊涨0.29%。中概股普遍下跌，环球墨非跌21.46%，逸仙电商跌10.35%。10月份，道指跌1.36%，标普500指数跌2.2%，纳指跌2.78%。

美债收益率集体收涨，2年期美债收益率涨2.7个基点报5.096%，3年期美债收益率涨2.6个基点报4.929%，5年期美债收益率涨2.3个基点报4.856%，10年期美债收益率涨3.2个基点报4.933%，30年期美债收益率涨3.7个基点报5.093%。

纽约尾盘，美元指数涨0.55%报106.72，非美货币普遍下跌，欧元兑美元跌0.37%报1.0576，英镑兑美元跌0.18%报1.2148，澳元兑美元跌0.58%报0.6337，美元兑日元涨1.77%报151.69，美元兑瑞郎涨0.93%报0.9104，离岸人民币对美元跌174个基点报7.3426。

■ 今日提示

9:45 中国10月财新制造业PMI

22:00 美国10月ISM制造业PMI

■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

1, 商品相关信息:

国际油价全线下跌，美油12月合约跌1.17%，报81.35美元/桶。布油明年1月合约跌1.1%，报85.40美元/桶。10月份，美油12月合约跌10.38%，布油明年1月合约跌7.35%。

2, 夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘，能源化工品多数上涨，LPG涨2.43%，低硫燃料油涨2.27%，燃油涨1.66%，苯乙烯涨1.32%，沥青涨1.05%。黑色系全线上涨，铁矿石涨1.67%。农产品多数上涨，豆油涨近1%。基本金属全线收跌，沪锡跌3.32%，沪镍跌2.21%，不锈钢跌1.3%，沪锌跌0.87%，沪铅跌0.28%，沪铝跌0.21%，沪铜跌0.15%。

■ 策略参考和回顾

1, 金融

昨PMI制造业数据低于预期，股市短期承压，但午后大盘蓝筹护盘，收敛了跌势。5年一次的金融工作会议召开，会议释放积极信号。股指处于政策底后市场底逐步确认的阶段，个股关注以华为产业链为代表的科技股，股指关注高弹性的IM。

2, 商品



维持工业品特别是基建相关商品震荡做多思路，高基差商品具有做多安全垫。重点参考矿石、焦煤、纯碱、玻璃、PVC、沥青等，同时基于原油的剧烈波动，化工单边的难度加大，可关注高低硫燃油的对冲（买低硫抛高硫）的机会，或跨品种对冲（买沥青抛高硫燃油）的机会。



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

