



# 华鑫期货每日晨报

2023年11月6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, 美国10月就业超预期放缓预示美联储加息周期已结束

美国10月就业超预期放缓，美联储加息周期或已结束！美国劳工部发布数据显示，10月新增非农就业15万人，为2022年以来第二低，预期为18万，9月新增就业人数由33.6万人下修至29.7万人，8月份也被大幅下调6.2万人至16.5万人。10月失业率反弹至3.9%，升至近两年新高，预期为持平于3.8%。10月份薪资增速小幅放缓至4.1%，为2021年年中以来最低。

资本市场

1, 上周五国内股市

A股震荡上行，题材股集体爆发，机器人、减速器概念井喷，市场近3900股上涨。上证指数收涨0.71%报3030.8点，深证成指涨1.22%，创业板指涨1.47%，科创50指数涨1.8%，北证50涨1.61%，万得全A涨1.07%，万得双创涨1.81%。市场成交额8111.9亿元，北向资金实际净买入超71亿元，贵州茅台、比亚迪、东方财富等获加仓；韦尔股份连续4日遭抛售，遭净卖出5.36亿元。本周，上证指数累计涨0.43%，深证成指涨0.85%，创业板指涨1.98%，均录得周线两连阳。

港股放量大涨，恒生指数收盘涨2.52%报17664.12点，周涨1.53%；恒生科技指数涨3.25%，周涨3.45%；国企指数涨2.39%，周涨1.23%。科网股、新能源汽车、非必须消费品涨幅居前。全日大市成交909亿港元，南向资金净买入11.58亿港元，快手、腾讯、小米齐获加仓。中国台湾加权指数收涨0.68%。

2, 上周五美股、美债与汇率

美国三大股指全线收涨，道指涨0.66%报34061.32点，标普500指数涨0.94%报4358.34点，纳指涨1.38%报13478.28点。本周，道指涨5.07%，标普500指数涨5.85%，纳指涨6.61%。高盛涨4.36%，沃尔格林联合博姿涨2.84%，领涨道指。万得美国TAMAMA科技指数涨0.87%，英伟达涨3.45%，特斯拉涨0.66%。中概股普遍上涨，开心汽车涨49.57%，海川证券涨13.86%。

美债收益率全线收跌，2年期美债收益率跌15.5个基点报4.845%，3年期美债收益率跌15.4个基点报4.638%，5年期美债收益率跌13.6个基点报4.504%，10年期美债收益率跌9个基点报4.572%，30年期美债收益率跌3.4个基点报4.763%。



纽约尾盘，美元指数跌1.02%报105.0541，周跌1.43%。非美货币集体上涨，欧元兑美元涨1.01%报1.073，周涨1.57%；英镑兑美元涨1.47%报1.2382，周涨2.1617%；澳元兑美元涨1.18%报0.651，周涨2.76%；美元兑日元跌0.72%报149.383，周跌0.18%；美元兑加元跌0.84%报1.3655，周跌1.59%；美元兑瑞郎跌0.77%报0.899，周跌0.41%；离岸人民币对美元涨400个基点报7.2883，本周累计涨454个基点。

## ■ 今日提示

17:00 欧元区10月服务业、综合PMI终值

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1, 商品相关信息:

中钢协公布数据显示，10月下旬，21个城市5大品种钢材社会库存857万吨，环比下降4.8%，库存降幅扩大；比9月下旬下降4.4%；比年初上升14%；同比上升2.5%。

联合国粮农组织2023年全球谷物产量最新预报数保持在28.19亿吨，同比增长0.9%（2600万吨）。10月粮农组织食品价格指数平均为120.6点，环比下跌0.5%，同比下跌10.9%。

10月份中国大宗商品指数为102.8%，环比回落0.8个百分点。分项指数中，供应指数、库存指数双双上升，销售指数则有所下降。其中，大宗商品供应指数为103.9%，上升0.5个百分点，指数三连升至近期高点。

### 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，能源化工品涨跌不一，纯碱涨2.6%，纸浆涨2.11%，甲醇涨1.48%，苯乙烯跌1.57%，20号胶跌1.1%，丁二烯橡胶跌1%。黑色系全线上涨，焦煤涨2.05%，焦炭涨1.29%，螺纹钢涨1.19%，热卷涨1.13%。农产品普遍上涨，菜粕涨1.19%，豆粕、玉米淀粉涨近1%。基本金属多数收涨，沪锡涨0.93%，沪镍涨0.89%，不锈钢涨0.59%，沪铅涨0.51%，沪铝涨0.08%，沪锌跌0.09%，沪铜跌0.47%。

## ■ 策略参考和回顾

### 1, 金融

维持近期策略：回调中线买入远期IM。



## 2, 商品

整体维持上周策略并做部分微调：回调中线买入高基差商品，如焦煤、矿石、纯碱、玻璃、尿素、双粕、油脂等，黑色系中，关注钢厂利润修复的可能，即螺卷补涨，矿石是市场热点，但注意可能的政策风险，对短期盘面影响。关注金铜比和金银比，以此为风险偏好转向的参考指标，并判断未来风险资产价格的回升是否将拓展至有色和其他化工品。



## 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

