



# 华鑫期货每日晨报

2023年11月8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, 国有资本向关系国家安全、国民经济命脉的重要行业和关键领域集中

中央全面深化改革委员会召开第三次会议强调, 推动国有资本向关系国家安全、国民经济命脉的重要行业和关键领域集中, 向关系国计民生的公共服务、应急能力、公益性领域等集中, 向前瞻性战略性新兴产业集中。加强对电力、油气、铁路等行业具有自然垄断属性环节的监管, 推动相关企业聚焦主责主业, 增加国有资本在网络型基础设施上投入; 对自然垄断环节开展垄断性业务和竞争性业务的范围进行监管, 防止利用垄断优势向上下游竞争性环节延伸。会议还强调, 要加大对突出生态环境问题集中解决力度。

#### 2, 10月我国外贸进出口同比增速转正

海关总署发布数据显示, 10月份我国货物贸易进出口总值3.54万亿元, 月度增速由6月起连续4个月同比下降转为增长0.9%。其中, 出口下降3.1%, 前值降0.6%; 进口增6.4%, 前值降0.9%。根据中国海关贸易景气统计调查, 对未来进口、出口表示乐观的企业占比提升, 我国外贸向好发展态势进一步显现。

#### 3, IMF上调中国经济增长预期

IMF预计今明两年实际GDP将分别增长5.4%和4.6%, 较此前预计均上调0.4个百分点。IMF指出, 中国不会出现通缩情况, 随着产出缺口持续缩小, 预计到2024年底, 核心通胀将升至2.1%。

### 资本市场

#### 1, 昨日国内股市

A股探底回升, 中小票再度出现普涨, CPO、算力概念涨势强劲, 新能源、大消费依旧疲软。全天超2800家公司上涨, 赚钱效应继续保持。上证指数收盘微跌0.04%报3057.27点, 深证成指跌0.15%, 创业板指跌0.47%, 北证50涨1.37%, 万得全A、万得双创双双收涨; A股全天成交9950.1亿元; 北向资金净卖出近46亿元, 宁德时代遭净卖出11.17亿元。

香港恒生指数低开低走, 收盘跌1.65%报17670.16点; 恒生科技指数跌1.04%, 恒生国企指数跌1.54%。地产、保险股跌幅居前, 中国太保跌逾7%, 中国恒大跌近5%。大市成交896.29亿港元, 南向资金净买入额为95.67亿港元。中国台湾加权指数收盘涨0.21%。



## 2, 昨日美股、美债与汇率

美国三大股指全线收涨，道指涨0.17%报34152.6点，标普500指数涨0.28%报4378.38点，纳指涨0.9%报13639.86点。英特尔涨2.16%，赛富时涨2.14%，领涨道指。万得美国TAMAMA科技指数涨1.18%，亚马逊涨2.13%，特斯拉涨1.33%。中概股多数下跌，新濠博亚娱乐跌15.38%，亿航智能跌12.7%。

美债收益率全线走低，2年期美债收益率跌2.1个基点报4.926%，3年期美债收益率跌4.2个基点报4.694%，5年期美债收益率跌5.5个基点报4.543%，10年期美债收益率跌7.8个基点报4.574%，30年期美债收益率跌8.4个基点报4.73%。

纽约尾盘，美元指数涨0.22%报105.51，非美货币普遍下跌，欧元兑美元跌0.16%报1.0700，英镑兑美元跌0.37%报1.2299，澳元兑美元跌0.83%报0.6437，美元兑日元涨0.24%报150.43，美元兑瑞郎涨0.08%报0.9001，离岸人民币对美元跌9个基点报7.2822。

## ■ 今日提示

10:00 中国10月贸易账

次日1:00 EIA公布月度短期能源展望报告

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1, 商品相关信息:

国内成品油价格“三连降”！国家发改委发布通知，自11月7日24时起，国内汽、柴油价格每吨分别降低140元、135元。据测算，本次调价折合成升价，92号汽油、95号汽油、0号柴油分别下调0.11元、0.12元、0.11元。

EIA短期能源展望报告：预计2023年WTI原油价格为79.41美元/桶，此前预期为79.59美元/桶。预计2024年WTI原油价格为89.24美元/桶，此前预期为90.91美元/桶。预计2023年布伦特价格为83.99美元/桶，此前预期为84.09美元/桶。预计2024年布伦特价格为93.24美元/桶，此前预期为94.91美元/桶。

### 2, 夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘，能源化工品普遍下跌，燃油跌3.38%，低硫燃料油跌2.48%，LPG跌1.72%，苯乙烯跌1.44%，20号胶跌1.03%，PTA跌1.02%。黑色系涨跌不一。农产品涨跌互现，菜粕涨1.88%。基本金属多数收跌，沪镍跌2.54%，不锈钢跌1.47%，沪铝跌0.39%，沪铜跌0.25%。



## 策略参考和回顾

### 1, 金融

总体维持之前观点和策略。人民币反弹带动包括A股、港股等人民币资产反弹。A股科技股和港股科技股是本轮反弹中坚，IM在各期指中更具价格弹性。个股围绕科技和医药，指数紧盯双创指数，期指维持IM中期买入策略。

### 2, 商品

总体维持之前观点和策略。在宏观转暖的背景下，维持高基差商品买入策略，包括如焦煤、矿石、纯碱、玻璃、尿素、双粕、油脂等，黑色系中，关注远期5月合约机会。矿石是市场热点，但注意可能的政策风险，对短期盘面影响。短线上，注意交易节奏，连续大涨后，或面临减仓震荡调整，但趋势较难改变。

11月中旬后，关注虚实比指标，即主力1月合约与仓单的比值，如果数据偏高，同时基差又处于高位，谨防8月份的挤仓行情重演。



## 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

