



# 华鑫期货每日晨报

2024年1月17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、国务院总理李强在世界经济论坛2024年年会表示中国经济稳健前行

国务院总理李强在世界经济论坛2024年年会开幕式上发表特别致辞称，中国经济稳健前行，将持续为世界经济发展提供强大动力。中国是全球发展的重要引擎，这些年对世界经济增长贡献率一直保持在30%左右。2023年中国经济总体回升向好，预计国内生产总值增长5.2%左右，高于年初确定的5%左右的预期目标。

#### 2、2023年中国经济“成绩单”即将公布

国务院新闻办公室定于1月17日（星期三）上午10时举行新闻发布会，国家统计局局长康义介绍2023年国民经济运行情况，并答记者问。届时，中国2023年GDP、工业生产、投资、消费及居民收入等重磅数据均将出炉。调查显示，多数经济学家认为，2023年中国经济增长目标将顺利实现，在2024年一季度至未来半年内，民间投资信心将有所改善，物价水平将温和上涨。

### 资本市场

#### 1、昨日国内股市

大金融板块护盘，A股“V形”反弹。截至收盘，上证指数上涨0.27%报2893.99点，深证成指涨0.31%，创业板指涨0.38%，北证50涨5.30%，科创50涨0.52%，上证50涨0.47%，深证50涨0.78%，万得全A涨0.13%，万得双创跌0.08%，万得微盘股指数跌0.70%。个股方面，同花顺股价大跌9.72%，报129.97元/股，创近10个月新低。A股成交额为6975.6亿元，北向资金净卖出41.33亿元，长安汽车遭净卖出6.7亿元最多，北方华创获净买入3.02亿元居首。

香港恒生指数收跌2.16%，报15865.92点，创逾14个月新低；恒生科技指数跌2.29%，恒生国企指数跌1.90%。消费股领跌，百果园集团跌逾30%，公司称股价波动属资本市场正常现象，目前经营一切正常；科技股跌幅居前，京东健康跌近7%。大市成交844.13亿港元，南向资金净买入29.45亿港元，中国移动获净买入4.64亿港元居首，香港交易所遭净卖出1.77亿港元最多。中国台湾加权指数收跌1.14%，报17346.87点。

#### 2、昨日美股、美债与汇率



美国三大股指全线收跌，道指跌0.62%报37361.12点，标普500指数跌0.37%报4765.98点，纳指跌0.19%报14944.35点。波音跌7.9%，耐克跌3.19%，领跌道指。万得美国TAMAMA科技指数跌0.1%，脸书跌1.88%，特斯拉涨0.47%。中概股普遍下跌，陆金所控股跌10.43%，小鹏汽车跌9.86%。

美债收益率集体上涨，2年期美债收益率涨8.2个基点报4.23%，3年期美债收益率涨8.5个基点报4.014%，5年期美债收益率涨10.4个基点报3.937%，10年期美债收益率涨12.4个基点报4.062%，30年期美债收益率涨12.4个基点报4.298%。

纽约尾盘，美元指数涨0.73%报103.34，非美货币普遍下跌，欧元兑美元跌0.7%报1.0874，英镑兑美元跌0.74%报1.2638，澳元兑美元跌1.82%报0.6585，美元兑日元涨0.99%报147.19，美元兑瑞郎涨0.55%报0.8608，离岸人民币对美元跌329个基点报7.2190。

## ■ 今日提示

10:00 中国去年第四季度及全年GDP

18:00 欧元区去年12月CPI

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1、商品相关信息：

上海有色网最新报价显示，1月16日，国产电池级碳酸锂价格上涨340元报9.66万元/吨，近5日累计上涨620元，近30日累计下跌31400元。

### 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，纯碱涨2.96%，玻璃涨1.26%，低硫燃料油涨1.11%，LPG涨1.08%。黑色系全线上涨，焦炭涨2.13%，焦煤涨1.91%，铁矿石涨1.55%。农产品多数上涨，豆二涨近1%。基本金属多数收涨，沪锡涨2.34%，不锈钢涨2.2%，沪镍涨0.6%，沪铝涨0.48%，沪铜涨0.29%，沪铅涨0.22%，沪锌跌0.47%。沪金跌0.44%，沪银跌0.27%。

## ■ 策略参考和回顾

### 1、金融：

昨日沪指创2020年5月以来新低后反弹，IF和IH翻红，IC和IM明显收敛跌幅。连续两日，日经ETF大幅波动，其中513520前日触及涨停，昨日盘中最高临近涨停，但尾盘放量跳水，成交呈罕见巨量，达到47.8亿元，同期日经指数波动明显小于该ETF，显示部分资金在国内市场连续下跌后，转投



日经ETF后的交易缺乏理性，而这也从侧面反应出目前国内信心处于极度匮乏，这或预示着否极泰来的临近。

昨日盘中探底反弹阶段，有所放量，若这现象持续，短期买点或出现。目前机会大于风险，绝对估值和相对估值均处于历史低位，IH和IF反弹后，IC和IM的弹性也将恢复。

## 2、商品：

(1) 集运指数：红海局势多变，建议谨慎交易。

(2) 有色：短期关注有色小金属如镍-不锈钢、锡、碳酸锂的表现，相关分析见最近几期有色周报。铜短期受制于美元，铝受制于氧化铝，但氧化铝基于近期2月期价贴水现价的幅度已经大幅收敛，料其短期跌幅已有限，后期铝自身基本面将显现优势，即产量面临天花板，而需求增长导致的持续低库存。

(3) 黑色：维持震荡思路。后期关注成材冬储，长期关注热卷表现和卷螺价差走阔。

(4) 粕和油脂：维持买油抛粕，首选豆粕和棕油。关注3月豆粕和3月菜粕的企稳，对远期双粕合约的支撑作用或将显现。

(5) 化工：继续关注基本面逐步改善的乙二醇EG和苯乙烯EB，以及低估值的PVC。



## 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。

华鑫期货研究所立足诚信和专业，秉承“高效研究 创造价值”的理念，深谙“知微见著，臻于至善”的投研内核，并基于宏观、产业、市场风偏和估值构建“四维一体”决策模型，助力各类客户包括产业型客户和交易型客户的成长。

王婧远

期货从业资格：F0288680

投资咨询资格：Z0010907

邮箱：wangjy@shhxqh.com

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

华鑫期货

华鑫期评

