



# 华鑫期货每日晨报

2024年1月23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、国务院常务会议强调要进一步健全完善资本市场基础制度

国务院常务会议听取资本市场运行情况及工作考虑的汇报，强调要进一步健全完善资本市场基础制度，更加注重投融资动态平衡；加大中长期资金入市力度，增强市场内在稳定性。要加强资本市场监管，对违法违规行为“零容忍”，打造规范透明的市场环境。要采取更加有力有效措施，着力稳市场、稳信心。

#### 2、开年首月LPR继续“按兵不动”

1年期LPR为3.45%，5年期以上LPR为4.2%，为连续5个月维持不变。业内人士认为，1月MLF利率维持不变，LPR报价的定价基础未发生变化符合预期，但后续仍有一定下调空间，一季度降准仍有可能。

### 资本市场

#### 1、昨日国内股市

周一A股深度调整，上证指数收盘跌2.68%报2756.34点，深证成指跌3.5%，创业板指跌2.83%，中小票跌幅较大，中证1000股指期货多张合约触及跌停。市场全天成交超8000亿元，北向资金尾盘抢筹，全天净买入超10亿元，宁德时代获净买入超7亿元；4只沪深300ETF再放历史巨量，合计成交额近380亿元。

香港恒生指数收盘跌2.27%报14961.18点，跌破15000点关口，续创逾14个月来低位；恒生科技指数跌3.02%，恒生国企指数跌2.44%，大市成交1121.78亿港元。内房股领跌，医疗保健股跌幅居前。零跑汽车跌逾12%，引入6.59亿港元战略投资。华星控股停牌近10个月后复牌涨逾68%。南向资金净买入6.56亿港元。

#### 2、昨日美股、美债与汇率

美国三大股指小幅收涨，道指涨0.36%报38001.81点，标普500指数涨0.22%报4850.43点，纳指涨0.32%报15360.29点。沃尔格林联合博姿涨2.55%，迪士尼涨2.17%，领涨道指。万得美国TAMAMA科技指数跌0.02%，特斯拉跌1.6%，微软跌0.54%。中概股普遍下跌，世纪互联跌12.73%，虎牙直播跌12.06%。



美债收益率多数下跌，2年期美债收益率涨0.5个基点报4.4%，3年期美债收益率跌1.6个基点报4.155%，5年期美债收益率跌2.7个基点报4.033%，10年期美债收益率跌2.5个基点报4.11%，30年期美债收益率跌1.5个基点报4.322%。

纽约尾盘，美元指数涨0.11%报103.35，非美货币表现分化，欧元兑美元跌0.14%报1.0883，英镑兑美元涨0.06%报1.2713，澳元兑美元跌0.44%报0.6570，美元兑日元跌0.05%报148.11，美元兑瑞郎涨0.11%报0.8691，离岸人民币对美元涨99个基点报7.1936。

## ■ 今日提示

23:00 欧元区1月消费者信心指数初值

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1、商品相关信息：

根据上海有色网最新报价显示，1月22日，国产电池级碳酸锂持平报9.66万元/吨，近5日累计涨340元，近30日累计跌21850元。

大商所发布套期保值交易手续费收费标准，将减半收取套期保值交易手续费。

### 2、夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘，能源化工品表现分化，纯碱涨2.73%，原油涨1.67%，20号胶跌2.58%，橡胶跌2.3%。黑色系全线上涨，铁矿石涨1.37%。农产品多数下跌，菜油跌1.33%。报572.7元/桶。基本金属期货夜盘多数收涨，沪锡涨0.71%，不锈钢涨0.53%，沪铅涨0.36%，沪镍涨0.13%，沪锌涨0.05%，沪铜跌0.12%，沪铝跌0.27%。沪金跌0.42%，沪银跌1.33%。

## ■ 策略参考和回顾

### 1、金融：

再创新低，上证50早盘一度翻红，但午后整体再度下跌，成长股领跌市场，IM远期触及跌停。短期市场进入非理性杀跌，市场有关于雪球敲入的传闻，IM和IC的期货贴水扩大。等待风险快速出清。

### 2、商品：



- 1) 集运指数：红海局势多变，建议谨慎交易。
- 2) 有色：建议继续关注有色小金属如镍-不锈钢、锡，相关分析见最近几期有色周报。大金属如铜铝短期受制于美元，同时铝暂时受到氧化铝波动影响。
- 3) 黑色：高基差的焦煤和矿石具有一定的做多安全边际，成材关注市场冬储动向。
- 4) 粕和油脂：继续维持买油抛粕策略，前期领跌的3月豆粕有筑底迹象，对远期粕价形成支撑。
- 5) 化工：继续关注基本面逐步改善的乙二醇EG和苯乙烯EB，昨日纯碱近月合约领涨，并先期涨停，带动远期普涨，市场焦点于节前补库导致期货对现货的基差修复。



## 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

