



# 华鑫期货每日晨报

2024年1月30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、国务院国资委将对中央企业全面实施“一企一策”考核

2024年，国务院国资委将对中央企业全面实施“一企一策”考核，即统筹共性量化指标与个体企业差异性，根据企业功能定位、行业特点、承担重大任务等情况，增加反映价值创造能力的针对性考核指标，“一企一策”签订个性化经营业绩责任书，引导企业努力实现高质量发展。国务院国资委将建立考核“双加分”机制——一档设置效益指标考核目标，对跑赢国民经济增速的企业给予考核加分，同步设立提质增效特别奖，对作出突出贡献的企业再给予额外加分，引导央企积极确定挑战性目标。国务院国资委还将探索将品牌价值纳入考核

#### 2、外资正在做多中国资产

数据显示，海外挂钩追踪中国股票的iShares中国大型股ETF的看涨期权交易量在近一周内出现骤增，达到一年多来的最高点。另外，专注于科技领域的KraneShares CSI中国互联网ETF的看涨合约交易量也水涨船高，攀升至历史第二高位。

#### 3、欧央行将于2024年4月首次降息

欧元区货币市场已完全定价欧洲央行将于2024年4月进行首次降息，降息幅度为25个基点，预计2024年欧洲央行将降息149个基点。

### 资本市场

#### 1、昨日国内股市

周一A股三大指数均下跌，创业板指再创调整新低。中字头整体延续强势，上海本地股分化，银行股全天护盘，白酒、家电、稀土永磁板块获资金关注；新能源与AI赛道深度调整，CPO概念全线杀跌，券商股集体下挫。截至收盘，上证指数跌0.92%报2883.36点，深证成指跌2.06%，创业板指跌3.49%，北证50跌6.58%，科创50跌2.79%，万得全A跌1.90%，万得双创跌3.57%，万得微盘股指数跌4.47%。市场超4800只个股下跌，全天成交8155.1亿元。北向资金尾盘流出额显著收窄，全天净卖出5.92亿元，药明康德遭净卖出6.91亿元最多，贵州茅台获净买入11.79亿元居首。

香港恒生指数收盘涨0.78%报16077.24点，恒生科技指数涨0.54%，恒生国企指数涨0.91%。消费、能源、电讯板块走强，百威亚太涨近7%领涨蓝筹。医药股高开低走，药明康德续跌近11%，药明生



物跌近6%。恒大系早盘临停前集体下挫，中国恒大下跌20.87%，恒大汽车跌18.21%，恒大物业跌2.5%，香港法院向中国恒大集团发出清盘令。大市成交1001.24亿港元，南向资金净卖出25.96亿港元，腾讯控股遭净卖出9.15亿港元最多，南方恒生科技获净买入3.92亿港元居首。中国台湾加权指数收涨0.69%，报18119.63点。

## 2、昨日美股、美债与汇率

美国三大股指全线收涨，道指涨0.59%报38333.45点，标普500指数涨0.76%报4927.93点，均续创历史新高，纳指涨1.12%报15628.04点。赛富时涨2.86%，迪士尼涨2.23%，领涨道指。万得美国TAMAMA科技指数涨1.18%，特斯拉涨4.19%，英伟达涨2.35%。中概股多数下跌，名创优品跌10.91%，好未来跌8.85%。

美债收益率全线走低，2年期美债收益率跌3.5个基点报4.328%，3年期美债收益率跌3.8个基点报4.117%，5年期美债收益率跌5.6个基点报3.99%，10年期美债收益率跌6.5个基点报4.08%，30年期美债收益率跌5.6个基点报4.317%。

纽约尾盘，美元指数跌0.01%报103.47，非美货币多数上涨，欧元兑美元跌0.19%报1.0833，英镑兑美元涨0.1%报1.2712，澳元兑美元涨0.56%报0.6611，美元兑日元跌0.45%报147.51，美元兑瑞郎跌0.35%报0.8613，离岸人民币对美元涨8个基点报7.1877。

## ■ 今日提示

9:20 中国央行公开市场有4650亿元逆回购到期

18:00 欧元区1月工业与经济景气指数

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1、商品相关信息：

世界钢铁协会表示，2023年12月，全球71个纳入世界钢铁协会统计国家的粗钢产量为1.357亿吨，同比下降5.3%。2023年全年全球粗钢产量为18.882亿吨。

### 2、夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘涨跌不一，能源化工品表现分化，LPG涨1.95%，纯碱涨1.25%。黑色系涨跌不一。农产品多数下跌，豆油跌1.6%，菜油跌1.43%，棕榈油跌1.26%。基本金属多数收跌，沪镍



跌1.09%，沪锡跌0.36%，沪锌跌0.26%，沪铝跌0.18%，不锈钢跌0.11%，沪铅涨0.15%，沪铜涨0.29%

。

## ■ 策略参考和回顾

### 1、金融：

昨日股市严重分化，双创指数单边下跌创新低，并使得尾盘阶段上证50转跌。IM和IC领跌市场，“中特估”对盘面形成一定的虹吸效应，成长股继续快速释放风险，谨防公募赎回和私募清盘线等压力再度出现。

### 2、商品：

- (1) 集运指数：外围风险事件，对航运指数影响减弱，市场有重回供大于求的基本面逻辑。
- (2) 有色：宏观利好有色，维持有色做多策略，目前有色整体库存偏低，后期注意供给如矿端搅动对盘面影响。具体分析见近期有色周报。
- (3) 黑色：震荡思路，矿石由于高基差，盘面稍强。近期焦煤累库，盘面转弱，可适量考虑买矿石抛焦煤策略。
- (4) 化工：继续关注部分化工节前下游补库，如EB、EG、TA等。
- (5) 粕和油脂：前期买油抛粕策略，可逐步考虑止盈退出。



## 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

