



# 华鑫期货每日晨报

2024年2月7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、中美经济工作组在京举行第三次会议

中美经济工作组在京举行第三次会议，双方就两国宏观经济形势及政策、二十国集团财金合作、发展中国家债务、产业政策等议题进行了深入、坦诚、务实、建设性的交流。中方就美对华加征关税、双向投资限制、制裁打压中方企业等表达了关切。国务院副总理、中美经贸中方牵头人何立峰会见来华出席中美经济工作组第三次会议的美副财长尚博一行。

#### 2、中央汇金：充分认可当前A股市场配置价值，已于近日扩大ETF增持范围，并将持续加大增持力度、扩大增持规模，坚决维护资本市场平稳运行。

中央汇金公司公告称，充分认可当前A股市场配置价值，已于近日扩大ETF增持范围，并将持续加大增持力度、扩大增持规模，坚决维护资本市场平稳运行。证监会表示，坚定支持中央汇金公司持续加大增持规模和力度，将其入市操作创造更加便利的条件和更加畅通的渠道。同时继续协调引导公募基金、私募基金、证券公司、社保基金、保险机构、年金基金等各类机构投资者更大力度入市，鼓励和支持上市公司加大回购增持力度。

### 资本市场

#### 1、昨日国内股市

多重利好交织刺激A股放量反攻，全市场涨停个股超过100家，近千股涨幅超8%。截至收盘，上证指数涨3.23%报2789.49点，盘中一度收复2800点；深证成指涨6.22%，创业板指涨6.71%；中证1000指数一度上涨8.1%，创历史最大单日涨幅。市场成交额9362.6亿元，创近2个月新高；北向资金净买入超126亿元，创逾一个月最大净流入额，核心资产连续获重金加持。

港股市场显著上扬，恒生指数收涨4.04%报16136.87点，恒生科技指数涨6.75%，恒生国企指数涨4.91%。医药、科技、工业板块涨幅居前，半导体爆发，内房股强势。大市成交1280.41亿港元，南向资金净卖出68.9亿港元，盈富基金遭大幅净卖出63.4亿港元。

#### 2、昨日美股、美债与汇率

美国三大股指小幅收涨，道指涨0.37%报38521.36点，标普500指数涨0.23%报4954.23点，纳指涨0.07%报15609点。沃尔格林联合博姿涨4.29%，耐克涨2.93%，领涨道指。万得美国TAMAMA科技指



数跌0.07%，英伟达跌1.6%，特斯拉涨2.23%。纽约社区银行跌22.36%，创2009年9月以来新低。中概股普遍上涨，达达集团涨20.24%，万国数据涨18.18%。

美债收益率全线走低，2年期美债收益率跌6.6个基点报4.414%，3年期美债收益率跌6.7个基点报4.202%，5年期美债收益率跌7个基点报4.053%，10年期美债收益率跌5.6个基点报4.107%，30年期美债收益率跌3.4个基点报4.305%。

纽约尾盘，美元指数跌0.27%报104.18，非美货币普遍上涨，欧元兑美元涨0.11%报1.0755，英镑兑美元涨0.5%报1.2597，澳元兑美元涨0.62%报0.6524，美元兑日元跌0.49%报147.95，美元兑瑞郎跌0.1%报0.8698，离岸人民币对美元涨185个基点报7.2015。

## ■ 今日提示

2月7日 中国1月外汇储备

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1、商品相关信息：

EIA短期能源展望报告：预计2024年布伦特价格为82.42美元/桶，此前预期为82.49美元/桶；预计2025年布伦特价格为79.48美元/桶，此前预期为79.48美元/桶。预计2024年WTI原油价格为77.68美元/桶，此前预期为77.99美元/桶；预计2025年WTI原油价格为74.98美元/桶，此前预期为74.98美元/桶。

### 2、夜盘动向：（按昨日结算价）

国内商品期货夜盘收盘，能源化工品多数上涨，苯乙烯涨3.36%，甲醇涨3.11%，PVC涨1.52%。黑色系全线上涨。农产品普遍上涨，豆二涨1.41%。基本金属涨跌不一，沪铝涨1.04%，沪锡涨0.61%，不锈钢涨0.37%，沪锌涨0.22%，沪铜跌0.01%，沪镍跌0.19%，沪铅跌0.28%。

## ■ 策略参考和回顾

### 1、金融：

（1）股指：持续密集利好下，昨日权益类市场强反弹，且成长领涨市场，连续两日显示，护盘资金逐步从前期上证50和沪深300的护盘扩展至中证1000等成长股中。IM领涨市场，远期6月收盘封于10%涨停，而主力2月合约，昨日贴水现指接近120点，今天收盘转为升水16点。权重股和成长股相继已经筑底完成，整体市场将迎来反弹行情，安全边际较高的是沪深300指数，即IF，而弹性更高的是中证1000，即IM，注意今日远期IC和IM的对现指的贴水是否继续快速收敛。



## 2、商品：

节前两个交易日，建议谨慎交易和持仓。夜盘化工整体“暴动”，伊朗两个年产分别为165万吨和230万吨甲醇装置停工，成为夜盘化工品行情启动的导火索。

（1）黑色：震荡为主，但注意节前两日，盘面或会受到同期股市波动影响。

（2）有色：外盘因素主导的铜博士调整中，但国内因素影响更多的铝开始转强，具体分析见近期有色周报。

（3）化工：苯乙烯在上游纯苯上涨和下游补库需求的共振下，继续领涨市场，夜盘甲醇突发事件，引领甲醇-烯烃产业链共振。

（4）农产品：维持适量买豆粕抛菜粕套利交易。



## 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

