



# 华鑫期货每日晨报

2024年3月15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、美国PPI数据超预期

美国PPI数据超预期，2月PPI同比升1.6%，预期升1.1%，前值升0.9%；环比升0.6%，预期升0.3%，前值升0.3%。核心PPI同比升2.0%，预期升1.9%，前值升2.0%；环比升0.3%，预期升0.2%，前值升0.5%。美国零售销售数据不及预期，2月零售销售环比升0.6%，预期升0.8%，前值降0.8%；核心零售销售环比升0.3%，预期升0.5%，前值降0.6%。美国上周初请失业金人数录得20.9万人，仍处于历史低位，预期21.8万，前值从21.7万修正为21万人。

#### 2、商务部将修订全国版外资准入负面清单

商务部新闻发言人何亚东表示，商务部将会同相关部门抓紧修订全国版外资准入负面清单，实现制造业领域外资准入限制清零。。

### 资本市场

#### 1、昨日国内股市

A股三大指数震荡走低，科技股全线回调，CRO概念股表现亮眼，有色金属、贵金属板块走强。截至收盘，上证指数跌0.18%报3038.23点，深证成指跌0.52%，创业板指跌0.64%，科创50指数跌1.24%，北证50跌0.39%，万得全A跌0.44%，万得双创跌0.89%。市场成交额10130亿元，连续4日破万亿；北向资金实际净买入64.22亿元，连续5日加仓，五粮液获净买入5.83亿元最多，药明康德遭净卖出9.45亿元居首。

港股冲高回落，恒生指数跌0.71%报16961.66点，恒生科技指数跌1.44%，恒生国企指数跌0.43%，医疗股领跌，科技股下挫，“蔚小理”齐跌，金融股走低。大市成交1131.3亿港元，南向资金净买入额为26.02亿港元，中国石油化工股份获净买入3.78亿港元最多，盈富基金遭净卖出7.74亿港元居首。中国台湾加权指数收盘涨0.05%，报19337.92点。

#### 2、昨日美股、美债与汇率

美国三大股指小幅收跌，道指跌0.35%报38905.66点，标普500指数跌0.29%报5150.48点，纳指跌0.3%报16128.53点。沃尔格林联合博姿跌2.04%，摩根大通跌1.74%，领跌道指。万得美国TAMAMA



科技指数涨0.47%，微软涨2.44%，特斯拉跌4.12%，英伟达跌3.24%。中概股普遍下跌，挚文集团22.29%，富途控股跌13.76%。

美债收益率集体收涨，2年期美债收益率涨5.9个基点报4.708%，3年期美债收益率涨8.6个基点报4.476%，5年期美债收益率涨9.2个基点报4.296%，10年期美债收益率涨10.4个基点报4.297%，30年期美债收益率涨9.4个基点报4.437%。

纽约尾盘，美元指数涨0.54%报103.37，非美货币普遍下跌，欧元兑美元跌0.59%报1.0883，英镑兑美元跌0.36%报1.2750，澳元兑美元跌0.61%报0.6581，美元兑日元涨0.38%报148.32，美元兑瑞郎涨0.55%报0.8837，离岸人民币对美元跌88个基点报7.2025。

## ■ 今日提示

21:15 美国2月工业产出/制造业产出

22:00 美国3月一年期通胀率预期

## ■ 商品相关信息和夜盘动向（按昨日结算价）

### 1、商品相关信息：

国际能源署（IEA）发布月报表示，由于欧佩克+减产，石油市场全年都面临供应短缺。将2024年全球石油需求预期上调11万桶/日，理由是美国前景改善，船用燃料使用量增加。该机构预计今年全球石油需求将增长134万桶/日，至1.032亿桶/日。

### 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，原油涨3.56%，20号胶涨1.89%，橡胶涨1.6%，PTA涨1.54%，低硫燃料油涨1.45%，苯乙烯涨1.43%，聚丙烯涨1.11%。黑色系全线下跌，焦煤跌3.07%，铁矿石跌1.79%，焦炭跌1.77%，螺纹钢跌1.66%，热卷跌1.39%。农产品多数上涨，棕榈油涨2.01%，菜粕涨1.11%。基本金属涨跌不一，沪铜涨0.27%，沪铅跌0.15%，沪铝跌0.34%，沪锌跌0.68%，沪镍跌1.08%。沪金跌0.24%，沪银涨0.21%。

## ■ 策略参考和回顾

### 1、金融：

（1）股指：昨整体市场震荡，成交保持活跃，连续四个交易日超万亿，北向资金连续五个交易日加仓。医药CRO、资源股大涨，科技股普跌。各期指均回落，其中IM领跌。



今日是3月合约最后交易日，市场存在移仓后的波动，短期震荡，但中期向上的趋势未变，维持做多策略，但重视资金管理。具体参考近期云策略报告和春季大类资产展望报告。

## 2、商品：

（1）有色：夜盘沪铜延续强势，其他有色涨跌互见，维持整体做多策略，重点铜铝镍锡，具体参考近期云策略报告和春季大类资产展望报告。

碳酸锂：昨日盘面大幅回落，供给紧缩预期降温，关注105000-108000一线支撑，多单谨慎持有。

（2）黑色：房夜盘螺矿继续阶段新低，5月螺纹持仓维持增加，延续弱势，维持做空策略，具体参考云策略和春季大类资产展望报告。短线关注持仓变化，若出现大幅减少，短期盘面震荡或加大。

（3）能化：原油延续强势，站上81美元大关，并创去年10月下旬以来新高，夜盘化工整体强势，部分创阶段新高，如EB、PP等。目前EB上游纯苯强势，同时叠加下游需求恢复与近期港口去库共振，维持中期看涨EB策略，具体参考近期云策略报告和春季大类资产展望报告。

（4）农产品：夜盘棕榈继续领涨农产品，5月棕榈油持仓持续增加，并高于去年同期水平，交易所仓单5千余手，5月持仓53万手，存在一定的逼仓风险。同期粕新高后有所调整，维持做多策略，具体参考近期云策略报告和春季大类资产展望报告。



## 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

