



资讯早间报

制作日期：2023/10/30

隔夜夜盘市场走势

- 国内商品期货夜盘收盘多数上涨，能源化工品普遍上涨，苯乙烯涨 2.56%，LPG 涨 1.18%，聚丙烯涨 1.07%，橡胶跌 2.58%，20 号胶跌 2.05%。黑色系全线上涨，铁矿石涨 1.94%，焦煤涨 1.37%。农产品多数上涨，豆粕涨 1.2%，豆二涨近 1%。基本金属集体收涨，沪锌涨 1.43%，沪铝涨 1.43%，沪锡涨 1.05%，沪铜涨 0.89%，不锈钢涨 0.79%，沪镍涨 0.71%，沪铅涨 0.59%。
- 国际贵金属期货普遍收涨，COMEX 黄金期货收涨 0.95% 报 2016.3 美元/盎司，当周累计涨 1.1%，COMEX 白银期货收涨 1.45% 报 23.24 美元/盎司，当周累计跌 1.12%。
- 国际油价全线上涨，美油 12 月合约涨 2.34% 报 85.16 美元/桶，周跌 3.32%；布油明年 1 月合约涨 2.44% 报 89.17 美元/桶，周跌 3.24%。
- 伦敦基本金属集体收涨，LME 期铜涨 1.32% 报 8091 美元/吨，周涨 1.79%；LME 期锌涨 1.27% 报 2466 美元/吨，周涨 1.15%；LME 期镍涨 1.47% 报 18345 美元/吨，周跌 1.31%；LME 期铝涨 1.27% 报 2225.5 美元/吨，周涨 2.02%；LME 期锡涨 0.46% 报 24915 美元/吨，周跌 0.28%；LME 期铅涨 0.43% 报 2103 美元/吨，周涨 0.17%。
- CBOT 农产品期货主力合约收盘涨跌不一，大豆期货涨 1.33% 报 1317.5 美分/蒲式耳，周涨 1.17%；玉米期货涨 0.47% 报 481.5 美分/蒲式耳，周跌 2.83%；小麦期货跌 0.65% 报 575.75 美分/蒲式耳，周跌 1.75%。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



重要资讯

【宏观资讯】

- 据巴基斯坦当地媒体 10 月 27 日报道，军方消息人士称，一架无人机试图侵入巴基斯坦，被巴基斯坦军队击落，随后印度军队向锡亚尔科特边界沿线的巴基斯坦哨所开火。
- 国家统计局数据显示，1-9 月份，全国规模以上工业企业实现利润总额 54119.9 亿元，同比下降 9.0%，降幅比 1-8 月份收窄 2.7 个百分点。9 月份，规模以上工业企业实现利润同比增长 11.9%。
- 广期所副总经理李震表示，广期所将持续推动新品种研发上市，加快新能源金属板块品种研究工作，稳步推进碳排放、电力期货品种研发，开展合约论证工作，努力研发更多满足产业客户和投资者需求的产品。
- 上海市地方金融监督管理局副局长葛平表示，上海市地方金融监管局将加强各类金融市场合作，支持更多期货产品创新。支持创新更多交易品种，研究探索外汇期货方案，更好服务国内、国际双循环。
- 美国财政部声明称，本月哈马斯袭击以色列后，美国对哈马斯实施第二轮制裁。制裁目标是哈马斯投资组合中的资产，以及协助哈马斯逃避制裁的人员，制裁目标包括伊朗的哈马斯官员和伊朗革命卫队成员。
- 据财政部数据，2023 年 9 月，全国发行新增债券 4240 亿元，其中一般债券 620 亿元、专项债券 3620 亿元。全国发行再融资债券 3511 亿元，其中一般债券 506 亿元、专项债券 3005 亿元。合计，全国发行地方政府债券 7751 亿元，其中一般债券 1126 亿元、专项债券 6625 亿元。



7. 央行发布2023年人民币国际化报告。其中提到，2022年，大宗商品贸易领域人民币跨境收付保持较快增长。全年主要大宗商品贸易跨境人民币结算金额合计9857.3亿元，其中，绿色新能源金属大宗商品贸易跨境人民币结算金额合计1623.6亿元。
8. 紫金矿业公告，为充分发挥公司金融板块与主业的协同作用，降低公司跨境投资及产业链投资涉及的市场波动风险，在不影响公司正常经营及风险有效控制的前提下，公司拟授权金融板块的下属企业使用部分闲置自有资金开展期货及衍生品交易业务。投资范围包括：挂钩境内外股票、大宗商品、外汇、固定收益等大类资产的期货、期权、场外等衍生产品。
9. 从宁波航交所获悉，宁波航运交易所发布的海上丝路指数之宁波出口集装箱运价指数（NCFI）报收于728.3点。其中，欧地航线方面，为即将到来的欧线长协签约季做准备，班轮公司宣布推涨欧地航线11月后开航航次的运价。

【能化期货】

1. 据SMM获悉，山东某大型氧化铝厂自10月27日起下调32%离子膜液碱采购价格，执行采购出厂价格760元/吨，折百2375元/吨，较前期下调50元/吨。
2. 乌克兰国家石油天然气公司负责人切尔尼绍夫表示，将于2024年底停止俄罗斯天然气经由乌克兰过境运输。
3. 亚洲基础设施投资银行与《联合国气候变化框架公约》第二十八次缔约方大会（COP28）主席国阿联酋日前宣布，将进一步加强合作，携手动员亟需的气候资金，加速清洁能源领域投资，帮助亚洲及其他地区应对相关资金短缺问题。



【金属期货】

- 据上期所数据，上周铜库存减少 21815 吨，铝库存减少 5128 吨，锌库存减少 5292 吨，铅库存增加 3109 吨，镍库存减少 139 吨，锡库存减少 227 吨。
- 据 SMM 获悉，云南省相关部门及电解铝相关部门共同会议商讨枯水期行业用电情况，有消息人士透露考虑到枯水期跨度时间长及来年的工业用电需求量，省内电解铝企业有减产 22% 预期，本周将确定各家电解铝厂压产比例，并开始执行。据 SMM 统计，截至 10 月中旬，云南 4 家电解铝企业合计运行电解铝产能 565 万吨，按照 22% 限产力度计算预期影响规模将达到 124.3 万吨。

【黑色系期货】

- Mysteel 统计全国 45 个港口进口铁矿库存为 11137.16 万吨，环比增 95.65 万吨；日均疏港量 293.85 万吨降 16.40 万吨。
- Mysteel 调研 247 家钢厂高炉开工率 82.49%，环比上周增加 0.15 个百分点，同比去年增加 1.01 个百分点；日均铁水产量 242.73 万吨，环比增加 0.29 万吨，同比增加 6.35 万吨。
- 据外媒报道，投票结果显示，必和必拓在西澳大利亚的 350 名铁矿石铁路工人（包括火车司机），已经批准了劳工行动计划，包括长达 24 小时的停工，因工资和工作条件引起纠纷。必和必拓表示，将在下周与工会进行更多的会谈。
- 据 Mysteel，未来一周，以唐山为主的京津冀地区空气质量水平预计中到重度污染，多地接到重污染 II 级预警通知，独立轧钢企业停产时间将延长。
- 据中国煤炭资源网，近期进口煤价格优势虽有收窄，但进口煤到货量仍然处于高位，对沿海电厂的补充作用依旧明显。据了解，电厂进口煤的库存都补到 11 月底了。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



-
6. 10月26日上午市场传出河北某主流钢厂计划27号焦炭采购价格下调干熄110元/吨，湿熄100元/吨的消息。Mysteel通过对河北多家钢厂调研得知，均否认此消息是由自家钢厂传出，10月27日也并未有钢厂继续跟进提降消息。
 7. 据钢银数据，本周城市总库存量为870.50万吨，较上周环比减少34.91万吨（-3.86%），包含39个城市，共计149个仓库。

【农产品期货】

1. 中共中央政治局10月27日召开会议，审议《关于进一步推动新时代东北全面振兴取得新突破若干政策措施的意见》。会议强调，要以科技创新推动产业创新，改造提升传统制造业，积极培育战略性新兴产业和未来产业，增强发展新动能。要发展现代化大农业，提高粮食综合生产能力，加强粮食稳产保供。
2. 据Wind数据显示，截至10月27日当周，自繁自养生猪养殖利润为亏损182.13元/头，10月20日为亏损147.41元/头；外购仔猪养殖利润为亏损165.56元/头，10月20日为亏损163.41元/头。
3. 加拿大谷物委员会最新发布的数据显示，截至10月22日当周，加拿大油菜籽出口量较前周增加2%至21.87万吨，之前一周为21.45万吨。自2023年8月1日至2023年10月22日，加拿大油菜籽出口量为130.61万吨，较上一年度同期的147.02万吨减少11.2%。
4. 据印尼棕榈油协会（GAPKI），印尼8月份棕榈油产量下降至422.1万吨；印尼8月份棕榈油出口下降至207.3万吨；印尼8月份棕榈油库存增至324.4万吨。
5. 据外媒报道，俄罗斯农业部上周五称，自11月1日开始，该国小麦出口关税将下调14.1%，至每吨4923.4卢布，此前七天的小麦出口关税为每吨5297.7卢布。该国大麦出口关税将连续第二周为零，玉米关税将从每吨2218.1卢布降至每吨1618卢布。最新关税有效期至11月7日。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



金融市场

➤ 金融

1、中央汇金公司宣布买入 ETF 后，资金持续涌入 ETF。数据显示，在 10 月 23 日至 10 月 27 日的一周内，A 股 ETF 净流入资金 154 亿元。沪深 300、科创板和创业板相关 ETF 是资金流入最多的标的，非银金融、芯片相关 ETF 也获资金追捧。

2、多个渠道透露，几只正在发行的浮动费率基金中，有部分产品的募集规模超过 10 亿元，总计规模或已经超 30 亿。业内人士认为，在权益市场震荡之下，让利型浮动费率基金的热销意味着市场信心已经有所恢复，也体现出投资者对于当前市场低位利于布局的共识。

3、截至目前，科创指数境内外产品规模超过 1600 亿元，其中科创 50ETF 产品规模超过 1400 亿元，为境内第二大宽基指数产品。

4、蚂蚁理财平台上一直颇受关注的“基金排行”功能近期做出新调整。作为可筛选榜单，基金排行新提供了“长期高赢率”、“低回撤率”等多个选基指标。

➤ 楼市

1、据澎湃新闻，《关于规划建设保障性住房的指导意见》已经下发。《指导意见》对保障性住房不得上市交易进行了明确的规定，包括对保障性住房实施严格的封闭管理，禁止违规将保障性住房变更为商品住房流入市场，工薪收入群体购买的保障性住房不得长期闲置等。

2、四大一线城市全部落实“认房不认贷”政策近两月后，市场一直期待着会不会有更进一步的房地产放松政策。近期广州、上海率先行动，针对部分区域、

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



人群进行限购的定向优化，体现了政策总体上继续宽松的可能。业内分析普遍认为，未来北京、深圳有望按照因区、因需施策原则，优化限购政策。

3、央行广西区分行对广西个人住房信贷政策进行积极调整，将全区首套住房贷款首付比例统一为 20%，并进一步下调各设区市首套房贷利率下限至历史低位。

4、针对北京链家退中介费的市场传闻，北京链家方面回应称，在途单客户实际缴纳超过 2%的部分将进行退费处理。

➤ 产业

1、北京市医保局近日通知，自 10 月 31 日起，本市医疗机构全面执行第二批中成药带量采购中选结果，其中，68 个品规药品中选，中选品种平均降幅 49.36%。

2、据中国载人航天工程办公室消息，中国航天员乘组完成在轨交接，神舟十六号航天员乘组已完成全部既定任务，将于 10 月 31 日乘坐神舟十六号载人飞船返回东风着陆场。

3、网友呼吁严查旅客航班信息泄露及利用其诈骗问题，中国民用航空局在答复中表示，正在编制相关文件，进一步加强对重要数据的保护；对于第三方网络渠道代理公司的旅客信息泄露等问题，将积极协调公安机关开展有关严查打击工作。

4、广西将“取卵术”等部分治疗性辅助生殖类医疗服务项目纳入医保，职工基本医疗保险、城乡居民基本医疗保险报销比例分别为 70%、50%。

5、全国通用人工智能行业产教融合共同体在北京门头沟成立，将围绕“一体、两翼、五重点”，推动校企联合科研创新。



6、白酒行业专家蔡学飞认为，虽然没有具体的数据，但是市场普遍认为，全国性的酱酒下沙量保守估计下降 15%-25%。

➤ 海外

1、据新浪，G7 将于周一就企业使用人工智能的行为准则达成一致。

2、亚投行与《联合国气候变化框架公约》第二十八次缔约方大会主席国阿联酋日前宣布，将进一步加强合作，携手动员亟需的气候资金，加速清洁能源领域投资。

➤ 国际股市

1、全球知名量化对冲基金 Two Sigma 称，研究人员未经许可调整了模型。美国证券交易委员会（SEC）在调查这 Two Sigma 研究员的行为。

2、在上周六与美国汽车工人联合会（UAW）达成一项初步协议后，Stellantis 目前正在就阻止其加拿大业务的罢工进行谈判。

➤ 债券

1、据经济参考报，10 月以来，超 20 省市相继发行特殊再融资债券，总额超万亿元。与此同时，中央财政将在四季度增发 1 万亿元国债，用于支持灾后恢复重建和弥补防灾减灾救灾短板；经全国人大常委会授权，国务院继续提前下达 2024 年新增地方政府债务限额。业内专家表示，近期财政政策接连出招明显发力，在三季度宏观数据回升向上的背景下，释放了稳增长政策持续发力的信号，目标兼顾防风险、补短板、稳增长，推动今年底明年初宏观经济继续回升向好。



2、美国10年期国债收益率日前一度涨破5%，达到2007年以来最高水平。一些分析师表示，10年期美债收益率未来可能进一步走高。宏观经济研究机构MRB合伙公司执行合伙人菲利普·科尔马预测，到2024年，美债收益率可能突破5.5%。

➤ 外汇

1、据中国证券报，前三季度，面对复杂严峻的外部环境和国内多重困难挑战，我国外贸展现出较强韧性，近期积极变化进一步增多。专家表示，随着积极因素不断积聚，以及稳外贸政策持续显效，年内外贸有望保持稳中有进态势，四季度出口增速有望进一步回升。



财经日历

经济数据

北京时间	指标
08:30	澳大利亚9月季调后零售销售
16:00	瑞士10月KOF经济领先指标
16:00	西班牙10月CPI
17:00	德国第三季度未季调GDP初值
17:30	英国9月央行抵押贷款许可
17:30	英国9月M4货币供应
18:00	欧元区10月消费者信心指数终值
18:00	欧元区10月工业景气指数
18:00	欧元区10月经济景气指数
18:00	欧元区10月服务业景气指数
20:00	加拿大至10月27日全国经济信心指数
21:00	德国10月CPI初值
22:30	美国10月达拉斯联储商业活动指数

财经大事

北京时间	事件
09:20	央行公开市场有8080亿元7天期逆回购到期

数据来源：Wind

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



注：本文资讯内容根据网络，冠通期货编辑整理而成，仅供投资者参考。

分析师：

王静，执业资格证号 F0235424/Z0000771。

本报告发布机构：

—冠通期货股份有限公司（已获中国证监会许可的期货交易咨询业务资格）

免责声明：

本报告中的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的内容和意见仅供参考，并不构成对所述品种买卖的出价或征价。我公司及其雇员对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失概不负责。本报告仅向特定客户传送，版权归冠通期货所有。未经我公司书面许可，任何机构和个人均不得以任何形式翻版，复制，引用或转载。如引用、转载、刊发，须注明出处为冠通期货股份有限公司。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货交易咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。