



## 资讯早间报

制作日期：2023/12/27

### 隔夜夜盘市场走势

1. 芝加哥期货交易所（CBOT）农产品期货主力合约集体收涨，大豆期货涨 0.88% 报 1311.25 美分/蒲式耳；玉米期货涨 1.59% 报 480.5 美分/蒲式耳，小麦期货涨 3.41% 报 637.25 美分/蒲式耳。
2. 国际贵金属期货收盘涨跌不一，COMEX 黄金期货涨 0.49% 报 2079.2 美元/盎司，COMEX 白银期货跌 0.26% 报 24.5 美元/盎司。
3. 国际油价全线上涨，美油明年 2 月合约涨 2.54%，报 75.43 美元/桶。布油明年 3 月合约涨 2.37%，报 80.67 美元/桶。
4. 国内商品期货夜盘，能源化工品多数下跌，丁二烯橡胶跌 2.04%，纯碱跌 1.69%，沥青跌 1.32%，PVC 跌 1.2%，甲醇跌 1.15%，乙二醇跌近 1%，原油涨 2.63%，20 号胶涨 1.89%，低硫燃料油涨 1.38%。黑色系全线下跌，焦煤跌 2%，焦炭跌 1.45%。农产品多数下跌，棉纱跌近 1%。基本金属多数收跌，沪镍跌 0.84%，沪锌跌 0.58%，不锈钢跌 0.36%，沪铜跌 0.25%，沪锡涨 0.96%。沪金跌 0.07%，沪银跌 0.13%。

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】

1. 国家发改委副主任李春临表示，将利用超大规模市场优势扩大内需。此举旨在构建东中西部产业梯度转移格局，并通过全国土地二级市场交易服务平台促进土地资源市场化配置，盘活存量资源。
2. 上期所、大商所、郑商所、中金所和广期所公布 2024 年部分节假日休市安排，春节期间，2月9日（星期五）至2月17日（星期六）休市，2月19日（星期一）起照常开市。2月4日（星期日）、2月18日（星期日）为周末休市。2月8日（星期四）晚上不进行夜盘交易。
3. 大商所发布关于 2024 年元旦节假日调整相关品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平的通知。通知提到，自 2023 年 12 月 28 日（星期四）结算时起，生猪品种期货合约涨跌停板幅度调整为 7%，交易保证金水平调整为 9%；液化石油气品种期货合约涨跌停板幅度调整为 8%，交易保证金水平调整为 9%；其他品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。
4. 郑商所发布关于 2024 年元旦休市期间风险提示的函。元旦休市期间（2023 年 12 月 30 日至 2024 年 1 月 1 日），影响商品价格走势的不确定性因素较多。请各会员单位做好投资者风险提示工作，增强风险意识，加强风险防范。
5. 证监会有关部门负责人表示，证监会组织证券交易所、期货交易所、中国结算等做了专门研究，制定了 2024 年全年的休市安排，特别是明确了除夕当日休市。谈及上述考虑安排，上述负责人表示，一是符合鼓励除夕放假的政策导向。二是贴近投资者的交易习惯。三是顺应市场呼声。
6. 上期能源所公告，2023 年 12 月 26 日，5 组 10 名客户在集运指数（欧线）期货 2404 合约上开仓交易数量超过交易所规定的交易限额，1 组 2 名客户在上

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。



期能源集运指数（欧线）期货 2404 合约、2406 合约上开仓交易数量超过交易所规定的交易限额，根据《上海国际能源交易中心交易规则》、《上海国际能源交易中心实际控制关系账户管理细则》、《上海国际能源交易中心异常交易管理细则》的相关规定，上期能源决定对上述客户采取限制开仓 5 个交易日、限制出金的监管措施。

7. 美国贸易代表办公室当地时间 12 月 26 日宣布，进一步延长对 352 项已恢复豁免关税的中国进口商品和 77 种与新冠防疫相关的中国进口商品的 301 条款关税豁免期，期限由今年 12 月 31 日延至 2024 年 5 月 31 日。

8. 北京时间 27 日凌晨，地中海航运（MSC）就商船在红海遇袭表示，MSC United VIII 商船向红海附近的联合行动部队军舰通报了这次袭击，并按照指示进行了规避动作；正在对船舶进行彻底评估；该船航线为沙特阿卜杜拉国王港至巴基斯坦卡拉奇。此前胡塞武装称，其在警告该商船三次无果后，用导弹瞄准了该船。

9. 据约旦媒体当地时间 12 月 26 日报道，约旦和埃及已同意运营连接亚喀巴和埃及地中海港口的海陆运输线，这一决定是在多家航运企业宣布因红海危机而改道后作出的。

## 【能化期货】

1. 据生意社，陕煤集团榆林化学有限责任公司 180 万吨/年乙二醇装置已连续运行 440 天，实现乙二醇年产量 180 万吨，提前 9 天达到设计产能目标，并完成集团年度产量目标的 150%。

2. 沙特政府数据显示，2023 年 10 月，沙特商品出口同比下降 17.4%。10 月石油出口价值同比下降 18.3%。10 月份非石油出口（包括转口）同比下降 13.9%。

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。



3. 上期所公告，当事人华钧地节1期私募证券投资基金（简称华钧地节1期）。2023年5月30日，在燃料油期货（FU）2306合约上华钧地节1期以自有账户违规交易影响期货价格。上述行为已构成《上海期货交易所违规处理办法》第三十条第一款第（五）项规定的违规行为，依据该办法第三十条之规定，本所决定：1. 给予华钧地节1期通报批评处分。2. 责令改正，并对华钧地节1期罚款4万元。

4. 有投资者在互动平台提问，公司有哪些措施以规避公司高管以信息差优势在期货市场进行期货交易？远兴能源回复称，经核实，公司董事、监事、高级管理人员未参与纯碱期货交易。

5. 商务部网站发布的《2024年成品油（燃料油）非国营贸易进口允许量申领条件、分配原则及相关程序》显示，2024年燃料油非国营贸易进口允许量为2000万吨。

### 【金属期货】

1. 据SMM统计，佛山地区铝锭库存较上一交易日增加0.24万吨，现报12.79万吨，铝棒库存较上一交易日减少0.05万吨至3.23万吨。

2. 广期所公告，自2023年12月28日（星期四）结算时起，工业硅期货合约涨跌停板幅度调整为8%，交易保证金标准调整为10%；碳酸锂期货合约涨跌停板幅度调整为15%，交易保证金标准调整为16%，其中碳酸锂期货LC2401、LC2402合约交易保证金标准维持20%不变。

### 【黑色系期货】

1. 12月24日，山西太原市改善省城环境质量领导小组办公室发布2023-2024年秋冬季环境空气质量保障第7号调度令，确定12月25日0时至27日24时，对四类污染源采取管控措施，在工业源减排上，对太钢、阳煤太化、太钢

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。



东山矿、美锦钢铁等重点工业企业提出减排要求。明确，全市已经停工的企业、企业内部已经停工的生产工序暂停恢复生产。

2. 据Mysteel，12月26日，中国45港进口铁矿石库存总量11894.83万吨，环比上周一增加207万吨，47港进口铁矿石库存总量12482.83万吨，环比增加171万吨。

3. 据央视新闻，12月26日，甘肃庆阳新庄煤矿首采工作面联合试运转正式启动，标志着华能陇东能源基地煤炭项目全部建成投产，项目完成后可增加优质资源储量9.15亿吨。

### 【农产品期货】

1. 农业农村部表示，下一步，农业农村部将坚持生产调控与市场调控“双管齐下”，优化完善《生猪产能调控实施方案》，精准开展生产预警引导，推动生猪产能稳定在合理水平。

2. 据马来西亚棕榈油协会（MPOA）发布的数据，马来西亚12月1-20日棕榈油产量预估减少8.59%，其中马来半岛减少7.15%，马来东部减少10.92%，沙巴减少10.7%，沙撈越减少11.58%。

3. 据马来西亚独立检验机构AmSpec，马来西亚12月1-25日棕榈油出口量为1100133吨，较上月同期出口的1154778吨下降4.7%。

4. 据南部半岛棕榈油压榨商协会（SPPOMA）数据显示，2023年12月1-25日马来西亚棕榈油单产减少13.39%，出油率减少0.07%，产量减少13.76%。

5. 据中国饲料工业协会，2023年11月，全国工业饲料产量2665万吨，环比下降3.5%，同比下降1.5%。主要配合饲料、浓缩饲料、添加剂预混合饲料产品出厂价格环比、同比均呈下降趋势。

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. 巴西蔗糖行业协会（Unica）周二称，12月上半月巴西中南部地区的糖产量达到92.5万吨，上年同期为30.3万吨。甘蔗压榨量为1908.3万吨，去年同期为554.3万吨。43.41%的蔗汁用于制糖，上年同期为39.74%。

7. 美国农业部数据显示，截至2023年12月21日当周，美国大豆出口检验量为1070411吨，前一周修正后为1425012吨，市场预期为80—158.5万吨；其中，对中国（大陆地区）装运346782吨，占到该周出口检验总量的32.40%。

## 金融市场

### ➤ 金融

1、中基协发布数据显示，截至2023年11月底，我国境内共有基金管理公司144家，其中，外商投资基金管理公司48家（包括中外合资和外商独资），内资基金管理公司96家；取得公募基金管理资格的证券公司或证券公司资产管理子公司12家、保险资产管理公司1家。以上机构管理的公募基金资产净值合计27.45万亿元。

2、银行业理财登记托管中心的统计显示，从今年2月份首批个人养老金理财产品推出到现在，共有6家理财公司发行了23只个人养老金理财产品，投资者累计购买金额超过17亿元。已发行的个人养老金理财产品，面向个人养老金投资者销售以来，都取得了正回报，部分产品年化收益率超过4%。

3、央行上海总部数据显示，11月份，长三角地区人民币贷款增加3345亿元，同比少增869亿元。

4、金融监管总局股份城商司发布专栏文章指出，推动股份制银行进一步完善差异化发展定位。鼓励股份制银行探索具有中国特色的现代商业银行治理制度，突出经营特色和竞争优势，在金融体系内发挥更加积极、正面的作用。支持具

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。



备能力的股份制银行在守住安全底线的前提下参与金融高水平对外开放，加大对共建“一带一路”的金融支持力度。

5、最高人民法院、最高人民检察院联合发布了依法从严打击私募基金犯罪典型案例。案例对司法实践中法律适用争议较大的问题进行了回应，进一步明确司法标准，加强办案指导。“两高”表示，下一步将持续加大对私募基金犯罪惩治力度。

6、截至12月26日，2023年以来清盘基金数量达到了256只，创下近五年（2019年以来）新高水平。其中，今年以来股票型基金清盘数量达61只，为公募基金业1998年肇始以来最高记录。此外，2023年以来FOF基金清盘数量突破两位数，达到了12只，猛增至2022年的三倍。其中，有7只为养老FOF产品。

7、随着收单外包服务市场的发展壮大，外包机构的规范经营变得愈加重要。近日微信支付对服务商合作协议和规则进行了修订，修订后的协议将于2024年1月8日起生效。与此同时，多家支付机构因多项违规，被监管警告并罚没金额超6000万元。

## ➤ 楼市

1、深圳贝壳研究院院长肖小平表示，经过两年多盘整，深圳楼市成交量已经筑底，预计2023年深圳新房成交3.18万套，同比下降8%；二手房预计成交3.24万套，同比增加50%，但是在去年低基数的前提下。肖小平表示，深圳楼市价格还在调整中。目前深圳二手房挂牌均价7.7万/m<sup>2</sup>，但成交价6万/m<sup>2</sup>左右，预计2024年还有调降空间。

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。



## ➤ 产业

1、据中汽协统计分析，1-11月，销量排名前十位的SUV生产企业共销售742.6万辆，占SUV销售总量62.9%。十家企业中，与上年同期相比，除一汽大众小幅下降外，其他企业均呈两位数增长，其中奇瑞汽车增速最为显著。

2、国家知识产权局相关负责人介绍，今年前11个月，我国电动汽车、锂电池、太阳能电池等产品出口分别达到2693亿元、4194亿元和2890亿元，呈现出良好的发展势头，相关产品在全球市场的占有率也在持续提升。

3、《上海海关支持集成电路产业发展监管创新实施办法》发布，健全覆盖集成电路产业链全流程的新型海关监管服务体系，提升上海集成电路产业创新能力和发展质量，促进产业集群升级发展。

4、国家药监局公开征求《药品生产质量管理规范》血液制品附录（修订征求意见稿）意见。本次修订内容主要是增加对血液制品生产、检验环节信息化和可视化的相关要求。第二十五条增加了要求血液制品生产企业督促浆站采用信息化手段如实记录原料血浆采集、贮存、运输及检验数据的规定。

5、华为正式发布问界M9，新车共推出4个版本，起售价为46.98万元，最高售价为56.98万元。问界M9目前预订量已突破54000辆，将于2024年2月26日规模交付。

## ➤ 海外

1、万事达卡发布报告显示，今年11月1日至12月24日期间美国零售销售额同比增长3.1%；其中，电商销售额同比增长6.3%，服装类和餐饮类的销售额分别同比增长2.4%和7.8%，而电子产品销售额同比下降0.4%。

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。





2、据英国经济和商业研究中心预测，英国将在未来 15 年内成为欧洲表现最好的主要经济体，缩小与德国的差距，扩大对法国的领先优势。到 2038 年，英国的 GDP 增长率将在 1.6%到 1.8%之间。

3、日本 11 月失业率 2.5%，预期 2.5%，前值 2.5%；求才求职比 1.28，预期 1.3，前值 1.3。

4、日本内阁府表示，2022 年日本人均名义 GDP 换算后为 34064 美元，在经济合作与发展组织（OECD）38 个成员国中排第 21 位。这是自 1980 年有可比数据以来最差名次，在七国集团（G7）中也自 2008 年之后再度垫底。日元贬值影响巨大，金额较上年下滑约 15%。

5、韩国房地产项目融资构成的威胁令人担忧。截至今年 11 月底，KB 国民银行、新韩银行、韩亚银行、友利银行、NH NongHyup 等 5 家主要银行的建筑贷款逾期金额为 1051 亿韩元（约 8100 万美元），比去年底的 524 亿韩元翻了个倍。拖欠率也从去年底的 0.26%上升到今年 11 月底的 0.45%。

## ➤ 国际股市

1、热门中概股多数上涨，巨喜生物涨 60.26%，盛美半导体涨 7.34%，高途集团涨 6.82%，网易涨 5.21%，知乎涨 3.99%，虎牙直播涨 3.55%，叮咚买菜涨 2.58%，新东方涨 2.47%，哔哩哔哩涨 2%；跌幅方面，盛大科技跌 5.02%，嘉楠科技跌 4.42%，世纪互联跌 3.48%，华住跌 3.36%。中概新能源汽车股集体上涨，蔚来汽车涨 10.81%，小鹏汽车涨 1.63%，理想汽车涨 3.77%。

2、微软 Xbox 游戏 AI 总经理 Haiyan Zhang 宣布与数字人开发公司 Inworld AI 签署了一项合作协议，将为开发者带来一系列开发工具，允许为游戏创建基于 AI 的 NPC。微软 Xbox 同时声称，未来将联合 Azure、Microsoft Research 等部门，为游戏开发者提供“最先进的 AI 工具”。

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。



- 3、美国国际贸易委员会（ITC）反对苹果提出的暂停手表销售禁令的上诉，同时向法院提出请求，要求法院拒绝缩短委员会对苹果提出的临时暂停动议的回应时间。
- 4、美国贸易代表办公室决定不推翻国际贸易委员会有关苹果侵犯了 Masimo 和 Cercacor Laboratories 的两项专利的裁定。
- 5、特斯拉因车门安全问题召回超过 12 万辆 Model S 和 X 电动汽车。当发生撞车事故时，特斯拉 2021-23 年的相关车辆产品可能会出现车门未锁问题。
- 6、业内人士指出，苹果可能不会在 2025 年的 iPhone 17 系列中采用自研 Wi-Fi 芯片设计，在未来两年内实现这一目标太困难。
- 7、谷歌近日推出 Google AI SDK，简化在安卓应用中集成高性能模型 Gemini Pro。
- 8、百时美施贵宝将以每股 62.50 美元现金收购 Rayzebio。
- 9、阿斯利康将以每股 2 美元现金收购亘喜生物，预计明年一季度完成交易。
- 10、美国证交会文件显示，截至 12 月 22 日，软银集团报告其在 T-Mobile US 的持股比例为 7.64%，而截至 6 月 1 日为 3.61%。
- 11、英国竞争与市场管理局表示，英国竞争上诉法庭维持了反垄断监管机构关于美国对讲机制造商摩托罗拉解决方案公司就其无线网络 Airwave 向英国紧急服务部门多收费用的调查结果。法庭驳回了摩托罗拉的上诉，摩托罗拉称反垄断监管机构在评估 Airwave 网络的盈利能力及其在相关市场的竞争情况时出现了错误。

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。



12、英特尔与以色列方面达成 32 亿美元激励方案协议，英特尔称以色列的激励计划将支持业务扩张。

13、阿达尼绿色能源公司将通过发行认股权证筹集 11.2 亿美元，同时将从与道达尔能源成立的合资公司融资 3 亿美元。

14、辉瑞称，收到印度拉贾斯坦邦 1671 万卢比的商品及服务税罚款通知，对运营无影响，可能对此提出上诉。

15、巴西石油巨头 Enauta Participacoes 以 1.5 亿美元收购包含巴西坎波斯盆地帕克孔查斯深水油气项目油田少数股份，该油气项目由壳牌石油公司运营，壳牌石油公司持有 50% 的股份。

16、多名知情人士称，在纳斯达克上市的俄罗斯科技公司 Yandex 的重组预计将推迟到 2024 年初完成。

17、索尼高管称，索尼 PlayStation5 游戏主机累计销量已经超过 5000 万台。索尼互动娱乐希望在截至明年 3 月的本财年内，PlayStation5 游戏主机销量达到 2500 万台，刷新公司历史纪录。

18、三星电子将得克萨斯州泰勒工厂的量产推迟到 2025 年。

## ➤ 债券

1、债市综述，跨年资金出现好转迹象，同业存单利率明显回落，现券短端整体走暖，短端主要活跃券收益率下行幅度达到 3-6 个 bp。银行间市场月内资金极为充裕，隔夜加权回购利率探至 1.5% 下方，创 11 月初以来新低，非银跨年价格仍贵。信用债方面，京东、龙湖债券上涨。

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。



2、中证转债指数收盘跌 0.43%，万得可转债等权指数收盘跌 0.88%。丽岛转债、三羊转债、金钟转债分别跌 16.6%、13.51%、13.08%；鸿达转债、金农转债、欧晶转债分别涨 20%、6.29%、4.12%。

3、央行 12 月 26 日开展 2023 年第十二期央行票据互换（CBS）操作，中标总量 50 亿元，期限 3 个月，费率 0.10%。

4、26 名原告向东京地方法院提起诉讼，寻求弥补三菱日联摩根士丹利证券出售给他们的 AT1 债券的损失，要求赔偿 17.3 亿日元（1220 万美元），这是针对瑞士信贷债券减记的最新诉讼。

5、债券重大事件，中诚信国际决定将甘肃电投集团的主体信用等级由 AA+调升至 AAA；“21 绵阳交通 MTN001”拟将现金要约收购；雅安发展投资控股股东变更；广安发展建设集团副总经理管卫东被查；中国葛洲坝集团前三季度累计新增借款超过上年末净资产的百分之三十。

## ➤ 外汇

1、周二在岸人民币对美元 16:30 收盘报 7.1445，较上一交易日跌 99 个基点，夜盘收报 7.1425。人民币对美元中间价报 7.0965，调升 45 个基点。

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。



## 财经日历

### 经济数据

北京时间	指标
9:30	中国1-11月规模以上工业企业利润
13:00	日本11月新屋开工/营建订单年率
17:00	瑞士12月ZEW投资者信心指数
21:00	加拿大至12月22日全国经济信心指数
21:55	美国至12月23日当周红皮书商业零售销售年率
23:00	美国12月里奇蒙德联储制造业指数
次日 05:30	美国至12月22日当周API原油库存

### 财经大事

北京时间	事件
7:50	日本央行公布12月货币政策会议审议委员意见摘要
9:20	中国央行公开市场有1340亿元逆回购到期
10:00	中国贸促会召开12月例行新闻发布会
	十四届全国人大常委会第七次会议12月25日至29日在北京举行

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。