



混沌天成國際有限公司
CHAOS INTERNATIONAL FINANCIAL LIMITED

国际期货晨讯速递

2020年02月17日星期一

重点新闻

环球经济

- 新冠肺炎疫情依然胶着，中国累计确诊人数超7万；在日本隔离的邮轮确诊病例升至355例；台湾和欧洲均报告首例死亡病例。湖北卫健委：2月16日全省新增新冠肺炎确诊病例1933例，新增病亡100例
- 路透社报导，中国外长王毅称美国在冠状病毒爆发期间实施旅行禁令，使中国难以执行两国之间的第一阶段贸易协议。美国贸易代表：根据美中第一阶段贸易协议成立双边评估与争议解决办公室
- 周五美国经济数据：密歇根大学消费者信心指数初值升至2018年以来最高水平，优于经济学家预期；1月零售额连续第四个月上升，但一项核心需求指标表现疲软；1月工业产值下降，受波音停产影响
- 多位OPEC代表透露，OPEC及其盟友接近放弃举行紧急会议的计画，不过沙乌地阿拉伯尚未完全放弃其提议
- 美银美林引述EPFR Global的数据称，疫情肆虐之际债券基金吸引创纪录资金流入，截至2月12日一周有236亿美元资金流入债券基金。纽约梅隆银行：随着如此之多的债券殖利率跌至零下，养老基金等机构投资者今年可能损失1万亿美元

股指

- 没有什么能够阻止美国股市连创新高。在冠状病毒可能全球大流行、打击全球成长的一周，标普500指数有四天上涨，其中三天创历史新高。
* 稳健的经济数据、好于预期的财报和联储会必要情况下准备采取行动的信号让投资者安心。标普500指数一周上涨1.6%，收于历史新高，11个板块如数上涨，高派息率股票领涨，因债券殖利率依然维持低位。英伟达创2017年以来最大周涨幅，此前报告第四季度业绩好于预期。能源和可选消费股下滑，科技、公用事业和房地产股上涨。在铺天盖地的冠状病毒疫情新闻中，标普500指数取得连续第二个周涨幅。「对病毒的担忧仍在持续，并且大概近期将是关注焦点，美国零售业的健康状况基本没有受病毒影响，因此我们可能不会看到此数据有任何影响，尤其是在早期，」E-Trade Financial投资策略副总裁Mike Loewengart说。「对于投资者而言，真正重要的是要记住美国基本面很强劲，我们的

经济仍在继续成长——至少在目前为止不像 2020 年经济停滞的预期」。标普 500 指数上涨 0.2%，报 3380.16 点。道琼工业平均指数下跌 0.1%，报 29398.08 点。那斯达克综合指数上涨 0.2%，报 9731.18 点。

- 斯托克欧元区 50 指数下跌 0.2%；斯托克欧洲 600 指数下跌 0.1%；英国富时 100 指数下跌 0.6%，法国 CAC 40 指数下跌 0.4%，德国 DAX 指数基本持平

外汇

- 美元指数周五略微走低，盘中一度跌 0.1%，当周累计跌幅不到 0.1%。美元兑 G-10 货币涨跌互见。加元和日圆领涨，瑞典克朗和瑞士法郎在 G-10 中表现落后。亚太地区 G-10 货币。美元/日圆几乎没有变化，报 109.77，波动区间 109.70-109.91。澳元/美元下跌 0.1%至 0.6713，盘中最大跌 0.2%。纽西兰元/美元下跌 0.1%至 0.6433，盘中一度涨类似的幅度

能源

- 油价取得今年最大周涨幅，儘管高盛认为需求前景黯淡。纽约原油期货周五上涨 1.2%，本月首次收在 52 美元之上。在中国向国际社会保证冠状病毒新病例激增是一次性事件之后，投资者的信心得到了提高。高盛集团将 2020 年原油需求增幅预测削减近一半、将第一季度油价预测下调 16%，未冲散投资者的乐观。「这番上涨无疑将激发人们对石油市场的更多信心，」KeyBanc Capital Markets 的分析师 Leo Mariani 表示几位 OPEC 代表透露，OPEC 及其盟友接近放弃举行紧急会议的计画，不过沙乌地阿拉伯尚未完全放弃其提议。由于冠状病毒疫情打击了中国的需求，在过去的两周中，沙乌地阿拉伯一直在敦促 OPEC 成员国及其盟友在本月开会，考虑进一步减产。纽约商业交易所 3 月 WTI 上涨 63 美分，结算价每桶 52.05 美元

金属

- 市场担忧病毒冲击经济，金价八周来第七周上涨。美国 1 月份工业产值下降。儘管下降主要是由于波音公司 737 Max 停产所致，但预计冠状病毒爆发将在未来几个月给供应链和需求造成压力。投资者连续 17 天增持黄金 ETF，使其持仓量达到历史新高。纽约商品交易所黄金期货价格上涨 0.5%，至每盎司 1,586.40 美元，本周涨幅达到 0.8%
- 上海金属库存激增强化供应过剩担忧，金属价格下滑。上海期货交易所仓库中的铜库存大增 27%，触及去年 3 月份以来最高水平，锌库存也飙升。虽然冶炼厂正计画减产以限制供应过剩，但分析师对需求迅速復甦的机会越来越悲观，因为工厂活动长期中断表明库存将进一步增加。伦敦金属交易所铜价下跌 0.5%，结算价为 5,760 美元/吨；本周上涨 1.7%

主要资料

2020年2月16日 已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
歐央行首席經濟學家連恩將討論英國脫歐後的歐洲經濟政策			
新西蘭 1 月製造業表現指數	4960.00%		4930.00%
日本 12 月第三產業活動指數月率	-0.20%		1.30%
德國第四季度 GDP 年率初值（工作日調整後）	0.40%	0.40%	0.50%
德國第四季度 GDP 年率初值（未季調）	0.003	0.003	0.01
德國第四季度 GDP 年率初值（季調後）		0.001	0.001
日央行副行長雨宮正佳發表講話			
歐元區第四季度 GDP 年率修正值	0.009	0.01	0.01
歐元區第四季度 GDP 季率修正值	0.10%	0.10%	0.10%
美國 1 月零售銷售月率	0.003	0.003	0.003
美國 1 月出口物價指數年率	0.005	-0.002	-0.009
美國 1 月製造業生產月率	-0.10%	-0.001	0.10%
美國 1 月工業生產月率	-0.30%	-0.20%	-0.40%
美國 2 月密歇根大學消費者信心指數初值	100.9	99.5	99.8
美國 12 月商業庫存月率	0.10%	0.10%	-0.20%
英央行行長卡尼出席上議院經濟事務委員會聽證會，並金融穩定和脫歐等問題答疑			
加拿大 1 月失業率	0.055		0.056
加拿大 1 月就業人數變化	3.45 萬		2.73 萬
加拿大 1 月全職就業人數	3.57 萬		3.39 萬
美聯儲向國會提交半年度貨幣政策報告			

2020年2月17日 即將公布經濟資料

經濟資料日程（預估為彭博調查所得預估中值；北京時間）

	主要資料	公布数值	预估数据	前值
	華盛頓總統日，美國休市一天			
5:30	新西蘭 1 月服務業表現指數	5710.00%		5190.00%
7:50	日本第四季度實際 GDP 年率初值	-6.30%	-3.80%	1.80%

7:50	日本第四季度名義 GDP 季率初值	-1.20%	-0.60%	0.60%
7:50	日本第四季度實際 GDP 季率初值	-1.60%	-1.00%	0.40%
8:01	英國 2 月 Rightmove 房價指數年率	0.029		0.027
12:30	日本 12 月工業生產年率終值			-0.03
	中國 1 月實際外商直接投資年率 (YTD) (2 月 17 日-2 月 20 日)			0.058
	中國 1 月實際外商直接投資年率 (2 月 17 日-2 月 20 日)			0.058
	中國 1 月新增人民幣貸款 (2 月 17 日-2 月 20 日)		30810 億人民幣	11400 億人民幣
	中國 1 月社會融資規模 (2 月 17 日-2 月 20 日)		42000 億人民幣	21000 億人民幣
	中国 1 月实际外商直接投资年率 (2 月 12 日-2 月 20 日)			5.80%
	中国 1 月新增人民币贷款 (2 月 12 日-2 月 15 日)		30810 亿人民币	11400 亿人民币
	中国 1 月社会融资规模 (2 月 12 日-2 月 15 日)		42000 亿人民币	21000 亿人民币

2020 年 02 月 14 日

主力期货合约日数据

指数期货	最高价	最低价	变动值	涨跌幅	收盘价	20 天	50 天	备注
小型道琼斯指数	29519	29267	-37	-0.13%	0	1.74%	2.83%	
小型标准普尔指数	3388.5	3365.25	3.5	0.10%	0	2.15%	3.89%	年高
小型纳斯达克 100 指数	9659.25	9588	19.25	0.20%	0	3.63%	7.57%	年高
富时 100 指数	7424.5	7339.5	-31	-0.42%	7359	0.29%	-0.24%	周低
德国 DAX	13788.5	13705	11.5	0.08%	13736.5	2.53%	3.30%	年高
富时中国指数	13660	13415	97.5	0.72%	13602.5	1.99%	-1.98%	
恒生指数	27908	27495	94	0.34%	27753	2.03%	1.66%	周高
日经 225	23780	23560	-160	-0.67%	23630	1.00%	0.79%	周低

外汇期货	最高价	最低价	变动值	涨跌幅	收盘价	20 天	50 天	备注
纽元	64.46	64.25	-0.09	-0.14%	0	-0.73%	-2.00%	
加元	75.55	75.36	0.04	0.05%	0	-0.05%	-0.66%	周高
澳元	67.35	67.13	-0.14	-0.21%	0	-0.22%	-1.65%	
瑞士法郎	102.34	102.01	-0.27	-0.26%	0	-0.70%	-0.67%	月低

欧元	1.08805	1.0846	-0.00035	-0.03%	0	-1.20%	-2.12%	年低
英镑	130.74	130.11	-0.21	-0.16%	0	0.24%	-0.19%	
日元	91.305	91.12	0.03	0.03%	0	-0.27%	-0.56%	
美元兑人民币	6.9943	6.9831	0.0006	0.01%	6.9901	0.20%	0.20%	
美汇指数	99.045	98.875	0.045	0.05%	99.003	0.97%	1.71%	年高

能源期货	最高价	最低价	变动值	涨跌幅	收盘价	20 天	50 天	备注
美原油	52.34	51.32	0.63	1.23%	0	0.04%	-8.00%	周高
布伦特源油	57.53	56.15	0.98	1.74%	57.32	0.53%	-6.65%	周高
天然气	1.854	1.795	0.011	0.60%	0	-0.10%	-9.41%	
无铅汽油	159.6	156.13	0.31	0.20%	0	3.97%	-2.08%	
低硫柴油	518.5	509.5	2	0.39%	514.5	0.44%	-8.42%	周高

农产品期货	最高价	最低价	变动值	涨跌幅	收盘价	20 天	50 天	备注
大豆	908.25	899.5	-2.75	-0.30%	0	0.26%	-2.39%	
小麦	548.75	541	-3.25	-0.60%	0	-2.02%	-0.94%	
玉米	386	380.75	-2.75	-0.71%	0	-0.65%	-1.00%	月低
原糖 11 号	14.9	14.5	-0.23	-1.56%	0	2.49%	6.51%	周低
棉花	68.9	68.08	-0.22	-0.32%	0	-0.77%	-0.73%	
可可	2921	2876	-9	-0.31%	0	3.56%	9.83%	

金属期货	最高价	最低价	变动值	涨跌幅	收盘价	20 天	50 天	备注
美国黄金	1588.2	1576	7.6	0.48%	0	0.82%	2.96%	周高
美国白银	17.79	17.595	0.115	0.65%	0	0.26%	0.82%	
美国铜	262.5	260.1	-1.3	-0.50%	0	0.54%	-3.99%	
美国钯金	2371.5	2311	-34.3	-1.46%	0	4.48%	13.92%	周高
美国铂金	979.1	965.7	-5.9	-0.61%	0	-0.25%	1.17%	周高
LME 铝	1751.5	1720	-26	-1.49%	1722	0.30%	-1.29%	

LME 铜	5794	5744.5	-30	-0.52%	5760	0.18%	-3.63%	
LME 铅	1885	1841	-19	-1.00%	1873	0.45%	-1.13%	
LME 锌	2180	2143	-26	-1.20%	2149	-2.44%	-4.41%	
LME 锡	16620	16510	-65	-0.39%	16525	0.03%	-2.08%	
LME 镍	13345	13010	-270	-2.03%	13015	2.36%	-1.81%	周高

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	162375	1206450	6815	66750	74825	212094
变化	-2175	-14550	-10	0	2325	2028

权益披露:

1. 混沌天成国际有限公司 (统称为「混沌天成国际」) 为根据香港法例第 571 章《证券及期货条例》获注册从事第 2 类 (期货合约交易) 受规管活动之持牌法团。
2. 混沌天成国际并没有持有此报告中的投资、工具及产品的权益 (不论从抵押权益或其他方式获得) 及仓盘 (好仓或淡仓)。

免责声明:

1. 此报告中所提供之数据及数据只供参考用途, 并不构成任何与投资有关之要约、招揽、邀请、诱使及申述, 亦不应被视为投资意见或推荐。
2. 此报告所载数据及数据均来自或编自混沌天成国际相信为可靠之来源, 惟并不明示或暗示地声明或保证任何该等数据或数据之准确性、有效性、时间性或完整性。混沌天成国际对此报告所载数据及数据的准确性或完整性并不负责或承担任何法律责任。
3. 此报告的版权均属混沌天成国际, 未经混沌天成国际事先书面明文批准下, 不得更改或以任何方式传送、复印或派发此报告的材料、内容或其复印本予任何非本公司客户。

风险披露:

1. 所有投资涉及风险, 过往表现并不反映未来表现。期货及期权合约价格可升可跌, 甚至变成毫无价值。投资者应就本身的投资经验、投资目标、财政资源, 风险承担能力及其他相关条件, 小心衡量自己是否适合参与任何投资项目。投资者应确保完全理解有关的投资性质及相关风险, 并愿意承担这种风险。当投资者在进行交易或投资中所涉及之性质、风险及适合性的任何方面有不明确或不明白的地方, 应寻求独立的专业意见。

