



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19日星期三

重点新闻

环球经济

- 中国新冠肺炎死亡人数达到至少 2000 人。世卫组织称中国采取的措施似乎已延缓病毒扩散，可能为世界其他地区赢得了数周应战疫情的准备时间。但沃尔玛、捷豹路虎等更多公司因疫情拉响业绩警报
- 川普叫停对中国禁售 GE 飞机引擎的计画以及其它限制美国出口的拟议措施，宣称国家安全这个借口被他手下人用得过于频繁，限制了企业与中国做生意的能力
- 美国因委内瑞拉问题而制裁俄罗斯石油子公司，因后者与委内瑞拉的马杜罗和国营委内瑞拉石油公司 (PDVSA) 保持着关系
- 新加坡将公布至少自 1997 年以来最大规模的预算赤字，拟拿出 64 亿新元来特别支持受疫情冲击的经济。规模远超 SARS 时期的 2.3 亿新元刺激方案
- 随着在民调中的支持率升高，布隆伯格首次获得民主党总统候选人辩论资格，桑德斯以全国 31% 的支持率排名第一，其次是布隆伯格，前副总统拜登

股指

- 美国股市下跌，苹果公司有关收入将无法达到预期的预警令投资者紧张不安，市场原本希望新冠病毒疫情造成有限的经济影响。美国国债上涨，美元走强。标普 500 指数从创纪录高点回落，因为苹果警告称疫情造成生产和需求放缓，与此同时，微软、亚马逊和 Facebook 的上涨为那斯达克 100 指数带来了小幅提振。包括 Dialog Semiconductor Plc 和 AMS AG 在内的苹果供应商拖累欧洲股市下跌。滙丰控股创 2009 年以来最大跌幅，此前该公司表示将在重组过程中裁减工作岗位，同时指出了新冠病毒带来的风险。投资者仍在判断疫情对企业和经济的影响，儘管疫情核心地区湖北省病例的成长企稳。与周一相比，市场情绪有所逆转，当时中国决策者采取行动支持因国内大部分地区停工而遭受打击的

公司，进而提振了市场情绪。必和必拓表示，如果疫情影响延续至下个月末之后，大宗商品价格将受到打击。「就其可能产生的影响而言，市场在很大程度上忽略了疫情的发展，但我不确定这是否完全合适，」Bryn Mawr Trust 首席投资官 Jeff Mills 表示。「这可能是暂时的，经济可能会反弹，但这与我们在 SARS 期间看到的情况不同。中国在全球经济占比提高了很多，交织程度也更高」。标普 500 指数下跌 0.3%，报 3370.29 点。道琼工业平均指数下跌 0.6%，报 29232.19 点。那斯达克综合指数持平，报 9732.74 点

- 斯托克欧元区 50 指数下跌 0.4%，报 3836.54 点；斯托克欧洲 600 指数下跌 0.4%，报 430.33 点。英国富时 100 指数下跌 0.7%，法国 CAC 40 指数下跌 0.5%，德国 DAX 指数下跌 0.8%

外汇

- 美元汇率指数上涨 0.2%，一度升至 11 月 29 日以来最高水平。亚太地区 G-10 货币。美元/日圆基本持平在 109.87。澳元/美元下跌 0.4%，至 0.6687。纽西兰元/美元下跌 0.8%，至 0.6386，在 G-10 货币中表现落后。

能源

- 油价基本持平，美国对俄罗斯石油的制裁行动帮助油价收復失地。美国对俄罗斯石油在瑞士成立的证券经纪公司 Rosneft Trading SA 进行制裁，因后者与委内瑞拉的马杜罗和国营委内瑞拉石油公司（PDVSA）保持着关系。「制裁措施将支持油价上涨，」Price Futures Group. 高级市场分析师 Phil Flynn 表示，「最终，俄罗斯不想在能源贸易中站在错误的一边。」。针对俄罗斯石油的行动代表了川普政府驱逐马杜罗以及为委内瑞拉反对派领导人胡安·瓜伊多争取国际支持的最新行动。俄罗斯石油称制裁措施非法并且毫无依据。纽约商业交易所 3 月份交割的 WTI 原油期货结算价报每桶 52.05 美元

金属

- 铜价下跌，因必和必拓及花旗发出警告；黄金触及多年高点。伦敦金属交易所 3 个月交割期铜跌 0.7%，收于每吨 5,773 美元。纽约 4 月交割黄金期货上涨 1.1%，收于每盎司 1,603.60 美元，为主力合约自 2013 年 3 月以来的最高收盘价。必和必拓表示，如果危机的影响延续到 4 月份，则原物料的需求和价格将受到打击，公司的预测可能会被修改。花旗集团分析师 Ed Morse 等在电邮报告中表示，「我们的基本结论是，市场对中国和全球市场出现 V 型反弹的预期过于自信了」。ED&F Man Capital Markets 的分析师 Edward Meir 在一封电子邮件中表示，「随着感染人数的减少，经济损失似乎正在增加」。诸如空中巴士、大众、通用和丰田等正在中国缓慢重启业务，这些公司。「不同程度地使用基本金属，因此随着需求低于标准水平，我们很可能会继续看到整个中国的金属库存增加」。道明分析师 Bart Melek 撰写报告称：「人们对避险资产的胃口似乎仍然无法满足」

主要资料

2020年02月18日已公布经济资料

| 主要资料 | 公布数值 | 预估数据 | 前值 |
|-----------------------|--------|-------|--------|
| 澳大利亚央行公布2月货币政策会议纪要 | | | |
| 中国香港1月失业率(季调後) | 3.40% | 0.035 | 3.30% |
| 英国12月三个月ILO失业人数变化 | -1.6万 | | -0.7万 |
| 英国12月三个月ILO失业率 | 3.80% | 3.80% | 3.80% |
| 英国12月三个月就业人数变化 | 18.0万 | 1.7万 | 20.8万 |
| 英国12月三个月平均工资年率(不包括红利) | 3.20% | 3.30% | 3.40% |
| 英国12月三个月平均工资年率(包括红利) | 2.90% | 3.00% | 3.20% |
| 英国1月失业人数变化 | 0.55万 | | 0.26万 |
| 英国1月失业率 | 3.40% | | 3.50% |
| 德国2月ZEW经济景气指数 | 8.7 | 22 | 26.7 |
| 欧元区2月ZEW经济景气指数 | 10.4 | | 25.6 |
| 德国2月ZEW经济现况指数 | -15.7 | -10 | -9.5 |
| 欧元区2月ZEW经济现况指数 | -10.3 | | -9.9 |
| 新西兰2月GDT乳制品价格指数 | -2.90% | | -4.70% |
| 美国2月NAHB房价指数 | 74 | 75 | 75 |

2020年02月19日即将公布经济资料

经济资料日程(预估为彭博调查所得预估中值;北京时间)

| | 主要资料 | 公布数值 | 预估数据 | 前值 |
|-------|--------------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 3:00 | 2020年FOMC票委、明尼阿波利斯联储主席卡什卡利发表讲话 | | | |
| 5:00 | 美国12月长期资本净流入 | 856亿美元 | | 229亿美元 |
| 6:15 | 新西兰联储主席奥尔在议会发表年度报告 | | | |
| 7:30 | 澳大利亚1月Westpac领先指标月率 | 0.05% | | 0.05% |
| 7:50 | 日本1月商品贸易帐(未季调) | -13126亿日元 | -16648亿日元 | -1525亿日元 |
| 8:30 | 澳大利亚第四季度工资成本指数年率 | 2.20% | 2.20% | 2.20% |
| | 中国1月新增人民币贷款(2月19日-2月20日) | | 30810亿人民币 | 11400亿人民币 |
| | 中国1月社会融资规模(2月19日-2月20日) | | 42000亿人民币 | 21000亿人民币 |
| 17:30 | 英国1月核心消费者物价指数年率 | | 1.50% | 1.40% |

| | | | | |
|-------|-------------------------|--|---------|--------|
| 17:30 | 英国 1 月消费者物价指数年率 | | 1.60% | 1.30% |
| 17:30 | 英国 1 月核心零售物价指数年率 | | 2.60% | 2.20% |
| 17:30 | 英国 1 月消费者物价指数月率 | | -0.40% | |
| 21:10 | 亚特兰大联储主席博斯蒂克就经济前景发表讲话 | | | |
| 21:30 | FOMC 票委、克利夫兰联储主席梅斯特发表讲话 | | | |
| 21:30 | 美国 1 月新屋开工月率 | | -12.90% | 16.90% |
| 21:30 | 美国 1 月营建许可月率 | | 2.10% | -3.90% |
| 21:30 | 加拿大 1 月消费者物价指数年率 | | 2.30% | 2.20% |
| 21:30 | 加拿大 1 月消费者物价指数月率 | | 0.20% | |

2020 年 02 月 18 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 | 29476 | 29100 | -184 | -0.63% | 29211 | 1.62% | 2.58% | 周低 |
| 小型标准普尔指数 | 3392.5 | 3355.25 | -11.75 | -0.35% | 3369.25 | 2.20% | 3.85% | 年高 |
| 小型纳斯达克 100 指数 | 9687.5 | 9534.25 | 3.75 | 0.04% | 9636 | 3.67% | 7.57% | 年高 |
| 富时 100 指数 | 7374 | 7302 | -66 | -0.89% | 7320 | -0.16% | -1.02% | 周低 |
| 德国 DAX | 13750.5 | 13651 | -120.5 | -0.87% | 13660 | 2.11% | 2.81% | |
| 富时中国指数 | 13827.5 | 13635 | -162.5 | -1.18% | 13662.5 | 3.52% | -0.76% | |
| 恒生指数 | 27893 | 27424 | -416 | -1.49% | 27426 | 2.37% | 1.38% | 周低 |
| 日经 225 | 23540 | 23110 | -340 | -1.44% | 23200 | 0.26% | -0.21% | 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 | 64.5 | 63.83 | -0.47 | -0.73% | 63.87 | -0.47% | -1.87% | 周低 |
| 加元 | 75.61 | 75.305 | 0 | 0.00% | 75.455 | 0.10% | -0.57% | 周高 |
| 澳元 | 67.37 | 66.77 | -0.24 | -0.36% | 66.9 | -0.04% | -1.57% | 周低 |
| 瑞士法郎 | 102.27 | 101.82 | -0.13 | -0.13% | 101.92 | -0.67% | -0.74% | 月低 |
| 欧元 | 1.08695 | 1.08025 | -0.00475 | -0.44% | 1.08115 | -1.13% | -2.15% | 年低 |
| 英镑 | 130.65 | 129.8 | -0.33 | -0.25% | 130.1 | 0.21% | -0.23% | |
| 日元 | 91.325 | 91.065 | -0.095 | -0.10% | 91.145 | -0.23% | -0.50% | |
| 美元兑人民币 | 7.0148 | 6.985 | 0.0263 | 0.38% | 7.0125 | 0.36% | 0.52% | 周高 |

| | | | | | | | | |
|------|--------|-------|-------------|--------------|--------|-------|-------|----|
| 美汇指数 | 99.375 | 99.03 | 0.33 | 0.33% | 99.333 | 1.10% | 1.96% | 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 | 52.41 | 50.88 | 0 | 0.00% | 52.05 | 0.78% | -7.68% | 周高 |
| 布伦特原油 | 57.83 | 56.3 | 0.08 | 0.14% | 57.75 | 1.97% | -5.88% | 周高 |
| 天然气 | 1.983 | 1.925 | 0.144 | 7.84% | 1.981 | 6.42% | -2.85% | 月高 |
| 无铅汽油 | 161.92 | 157.25 | 3.15 | 1.99% | 161.48 | 5.55% | -0.65% | 周高 |
| 低硫柴油 | 512.25 | 501.5 | -6.25 | -1.22% | 504 | 0.40% | -8.99% | |

| 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 | 908.75 | 899 | -1 | -0.11% | 902.25 | 0.70% | -2.30% | 周高 |
| 小麦 | 568.5 | 546.5 | 23.5 | 4.34% | 565 | 1.75% | 2.38% | 周高 |
| 玉米 | 387.5 | 382.25 | 5.5 | 1.44% | 387.5 | -0.07% | -0.65% | |
| 原糖 11 号 | 14.9 | 14.56 | 0.32 | 2.20% | 14.87 | 2.32% | 6.24% | |
| 棉花 | 69.72 | 68.42 | 0.46 | 0.67% | 68.87 | 0.65% | 0.35% | 周高 |
| 可可 | 2903 | 2827 | -40 | -1.39% | 2846 | 2.86% | 8.93% | 周低 |

| 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 | 1608.2 | 1584.8 | 17.2 | 1.08% | 1603.6 | 1.89% | 4.08% | 月高 |
| 美国白银 | 18.215 | 17.67 | 0.416 | 2.35% | 18.15 | 2.41% | 3.05% | 周高 |
| 美国铜 | 263.95 | 260.1 | 0.45 | 0.17% | 261.15 | 1.46% | -3.42% | 周高 |
| 美国钯金 | 2550 | 2331.8 | 180.9 | 7.81% | 2497.6 | 11.09% | 21.44% | 年高 |
| 美国铂金 | 996.4 | 966 | 25.1 | 2.59% | 993.9 | 1.40% | 2.69% | 周高 |
| LME 铝 | 1727 | 1707 | -1 | -0.06% | 1720 | -0.55% | -2.60% | |
| LME 铜 | 5814.5 | 5746 | -39 | -0.67% | 5773 | 1.27% | -3.23% | |
| LME 铅 | 1898.15 | 1846 | 25 | 1.33% | 1898 | 1.56% | -0.39% | |
| LME 锌 | 2173 | 2142.5 | -27 | -1.24% | 2145 | -1.47% | -4.58% | |
| LME 锡 | 16800 | 16430 | -100 | -0.60% | 16500 | 1.82% | -0.97% | 周高 |

| | | | | | | | | |
|-------|-------|-------|------|--------|-------|-------|--------|----|
| LME 镍 | 13185 | 12770 | -290 | -2.21% | 12820 | 1.82% | -2.92% | 周低 |
|-------|-------|-------|------|--------|-------|-------|--------|----|

伦敦金属交易所库存

| | 铜 | 铝 | 锡 | 铅 | 锌 | 镍 |
|----|--------|---------|------|-------|-------|--------|
| 库存 | 166475 | 1177425 | 7485 | 66725 | 74700 | 218214 |
| 变化 | 5075 | -14950 | 930 | 0 | -25 | 2412 |

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。