



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

国际期货晨讯速递

2021年03月05日星期五

重点新闻

环球经济

- 联储会主席鲍威尔最新讲话没有试图遏制长期利率的上升态势，令投资者失望，美债 10 年期殖利率升向一年高位，高盛上调 10 年期殖利率年末预测至 1.90%。美股重挫。周三公布的联储会褐皮书 31 次提到「短缺」一词，如果这种现象持续存在，可能会被解读为通膨预警信号。
- 美国商务部长表示将要求中国对反竞争行为和侵犯人权行为负责，并称川普对外国钢铁和铝征收的关税是「有效的」。
- 受疫情和严寒气候双重夹击，美国上周首次申请失业救济人数略有上升，超出经济学家预期。
- 美国 30 年期固定抵押贷款利率自 7 月份以来首次升至 3% 以上，令人担心更高的贷款成本将打断房地产市场繁荣。
- 美国国会预算办公室称，联邦债务有望在 2051 年达到经济规模的两倍以上，预计未来十年债务的净利息支出将保持在相对较低水平。
- 中国第十三届全国人大四次会议今天上午 9 点开幕，总理李克强将作政府工作报告。投资者密切关注刺激政策退出信号，GDP 成长目标，以及旨在降低对美国科技依赖的长期政策规划。

股指

- 标普 500 指数收于约五周低点，那斯达克 100 指数抹去年内涨幅，鲍威尔没有对美国国债殖利率近期升势做出更有力的打压，令市场感到失望。美国国债下挫，鲍威尔的讲话虽然强化了鸽派立场，但他没有对近期殖利率回升走势进行打压，也没有承认可能延长资产购买的加权平均期限。10 年期国债殖利率上涨 8.32 个基点，报 1.5640%

外汇

- 因美债殖利率劲升，美元涨至 12 月 1 日来最高。加元表现优于多数 G-10 货币，此前 OPEC+ 意外维持产油量不变导致油价攀升。衡量美元兑 G10 货币表现的彭博美元即期汇率指数上涨 0.7%，报 1,142.1。欧元/美元下跌 0.78%，报 1.1969 美元。美元/日圆上涨 0.91%，报 107.98 日圆。英镑/美元下跌 0.42%，报 1.3895 美元。美元/离岸人民币尾盘较前一交易日纽约尾盘上涨 0.22%，报 6.4918 元。

能源

- 原油价格周四升至接近两年来最高点，之前 OPEC+联盟出乎市场预料地决定维持产量不变，预示着未来几个月原油市场供应将趋紧。纽约市场原油期货上涨 4.2%，是沙特阿拉伯 1 月份承诺单方面减产以来最大涨幅；全球基准原油布伦特原油周四也走高。OPEC+产油国联盟周四在网络会议上同意 4 月份维持产量不变。沙特阿拉伯表示，不急于恢复供应，并将维持其每天 100 万桶的自愿减产，「4 月份维持目前的 OPEC+减产幅度恰好给了多头所需要的东西，」荷兰合作银行的大宗商品策略师 Ryan Fitzmaurice 表示。「沙乌地人精明地意识到，为了维持近期的价格上涨势头和对石油期货的投机性购买兴趣，他们需要‘激励多头」，4 月交割的西得克萨斯中质油上涨 2.55 美元，收于每桶 63.83 美元，为 2019 年 4 月以来最高水平，5 月份交割的布伦特原油期货价格上涨 2.67 美元，收于每桶 66.74 美元，为 2 月下旬以来最高。

金属

- 黄金价格周四触及 8 个月新低，之前联储会主席杰罗姆·鲍威尔没有对长期借贷成本上升表示强有力的反对，导致美国国债殖利率飙升。周四 10 年期美国国债殖利率触及本周高点，并朝着一年高点攀升。整个美国国债殖利率曲线也普遍走高，并提振了美元。由于国债殖利率上升，降低了非生息资产黄金的吸引力，导致今年金价下滑，投资者正在评估联储会购买更多长期债券以保持金融状况宽松的的意愿。鲍威尔在《华尔街日报》周四举办的网络研讨会上讲道，最近债券殖利率升势「显著，引起了我的注意。」他还表示正在关注金融状况，并且市场无序会令其「担忧」。
- 截至纽约时间下午 3:42，现货金价一度下跌 1.2%，至每盎司 1,690.49 美元，为 6 月以来的最低水平。在鲍威尔发表讲话之前，金价曾上涨了 0.7%，纽约商品交易所 4 月交割的黄金期货下跌 0.9%，收于每盎司 1,700.70 美元。白银、铂金和钯金也下跌。

主要资料

2021 年 03 月 04 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 1 月贸易帐	101.42 亿澳元	65 亿澳元	67.85 亿澳元
澳大利亚 1 月出口月率	6.00%	4.00%	3.00%
澳大利亚 1 月进口月率	-2.00%	-4.00%	-2.00%
澳大利亚 1 月零售销售月率终值	0.50%	0.60%	0.60%
日本 2 月家庭消费者信心指数	33.8	30	29.6
欧洲央行的森特诺在一次会议上发言			
德国 2 月 Markit 建筑业采购经理人指数	41		46.6
英国 2 月 Markit 建筑业采购经理人指数	53.3	51	49.2
欧元区 1 月失业率	8.10%	8.30%	8.10%

欧元区 1 月零售销售年率	-6.40%	-1.00%	0.90%
欧元区 1 月零售销售月率	-5.90%	-1.30%	1.80%
美国 2 月挑战者裁员年率	-39.10%		17.40%
美国上周初请失业金人数	74.5 万	75.5 万	73.6 万
美国截至 2 月 20 日当周续请失业金人数	429.5 万	430.0 万	441.9 万
美国第四季度非农单位劳动力成本终值	6.00%		-6.80%
美国第四季度非农生产力终值	-4.20%	-4.70%	-4.80%
加拿大第四季度劳动力成本季率	-2.00%	-1.90%	-10.30%
美国 1 月工厂订单月率	2.60%	1.80%	1.10%
美国 1 月工厂订单月率（除运输外）	1.70%	1.40%	1.40%
美国 1 月耐用品订单月率终值	3.40%	3.40%	3.40%
美国 1 月耐用品订单月率终值（除运输外）	1.30%	1.40%	1.40%

2021 年 03 月 05 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
5:30	澳大利亚 1 月 AIG 服务业表现指数	55.8		54.3
15:00	德国 1 月工厂订单年率		1.90%	6.40%
15:00	德国 1 月工厂订单月率		1.00%	-1.90%
15:45	法国 1 月经常帐			-12 亿欧元
15:45	法国 1 月贸易帐			-33.92 亿欧元
16:00	瑞士 2 月外汇储备			8961.50 亿瑞郎
16:00	中国香港 2 月外汇储备			4935 亿美元
17:00	意大利 1 月零售销售年率			-3.10%
17:00	意大利 1 月零售销售月率		-0.50%	2.50%
20:00	英央行官员霍尔发表讲话			
21:30	美国 2 月失业率		6.40%	6.30%
21:30	美国 2 月非农就业人数变化		18.0 万	4.9 万
21:30	美国 2 月平均时薪年率		5.30%	5.40%

21:30	美国 2 月平均每周工时		34.9	35
21:30	美国 2 月私人部门就业人数变化		19 万	0.6 万
21:30	美国 1 月贸易帐			-666 亿美元
21:30	美国 2 月 U6 失业率			11.10%
21:30	美国 2 月制造业就业人数变化		1 万	-1 万
21:30	美国 2 月就业参与率		61.40%	61.40%
21:30	美国 2 月平均时薪月率		0.20%	0.20%
21:30	加拿大 1 月贸易帐			-16.7 亿加元
22:00	英央行政委员哈斯克爾参加经济政策研究中心和芝加哥大学布斯商学院主办的小组讨论			
23:00	加拿大 2 月 Ivey 采购经理人指数 (季调后)			48.4

2021 年 03 月 04 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	31436	30512	-358	-1.15%	30878	0.36%	1.81%	月低
小型标准普尔指数	3842.25	3720.5	-51.1	-1.34%	3765.6	-0.87%	0.74%	月低
小型纳斯达克 100 指数	12797	12306.5	-226.75	-1.79%	12455	-3.83%	-2.61%	月低
富时 100 指数	6655	6549.5	-6	-0.09%	6632.5	1.30%	1.11%	
德国 DAX	14093	13893	-19	-0.14%	14050	0.84%	1.60%	
富时中国指数	18580	17911	-515	-2.77%	18052	-3.32%	-0.66%	
恒生指数	29719	28909	-606	-2.04%	29078	0.53%	4.14%	
日经 225	29770	28710	-610	-2.06%	28980	0.65%	4.35%	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	72.72	71.71	-0.67	-0.92%	71.92	0.22%	0.86%	周低
加元	79.52	78.775	-0.155	-0.20%	78.985	0.68%	1.12%	周高
澳元	78.15	77.085	-0.655	-0.84%	77.285	0.37%	1.13%	
瑞士法郎	108.85	107.58	-1.14	-1.05%	107.63	-1.69%	-2.76%	月低
欧元	1.20685	1.19635	-0.0101	-0.84%	1.19675	-0.22%	-0.64%	周低
英镑	140.18	138.8	-0.67	-0.48%	138.9	0.68%	2.01%	

日元	93.49	92.605	-0.805	-0.86%	92.68	-1.02%	-2.18%	月低
美元兑人民币	6.5225	6.5105	0.0071	0.11%	6.5189	0.38%	0.06%	
美汇指数	91.695	90.985	0.702	0.77%	91.644	1.19%	1.39%	月高

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	64.86	60.52	2.55	4.16%	63.83	7.11%	17.61%	年高
布伦特源油	67.75	63.33	2.67	4.17%	66.74	7.47%	16.82%	年高
天然气	2.826	2.684	-0.07	-2.49%	2.746	-1.09%	3.72%	月低
无铅汽油	202.42	191.66	4.61	2.36%	199.79	6.97%	17.33%	年高
低硫柴油	540.5	508.75	15.25	2.93%	535.25	4.28%	13.21%	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	1438	1403.5	3	0.21%	1410.5	3.48%	5.65%	周高
小麦	662	647.25	-5	-0.76%	651	0.78%	1.73%	
玉米	541	529.25	-2.75	-0.51%	532.5	-0.91%	3.82%	周低
原糖 11 号	16.41	15.96	0.12	0.74%	16.26	0.95%	6.37%	周低
棉花	89.39	86.63	-1.31	-1.48%	87.14	0.34%	6.48%	周低
可可	2640	2590	-32	-1.20%	2625	5.35%	5.97%	

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	1721.6	1687.6	-15.1	-0.88%	1700.7	-3.23%	-6.07%	月低
美国白银	26.385	25.08	-0.926	-3.51%	25.461	-2.54%	-0.63%	月低
美国铜	415.05	384.9	-16.35	-3.95%	397.85	4.59%	10.81%	周低
美国钯金	2373	2321	-11.6	-0.49%	2342.8	0.35%	0.37%	
美国铂金	1183.3	1120	-46.5	-3.93%	1135.3	-3.02%	3.75%	周低
LME 铝	2217	2130	-46.5	-2.11%	2153.5	4.37%	8.15%	
LME 铜	9132	8570	-194	-2.13%	8907.5	4.97%	10.92%	周低
LME 铅	2051	1997	-36	-1.76%	2015	-2.26%	-0.10%	月低

LME 锌	2794	2627	-38.5	-1.38%	2748.5	-0.34%	1.41%	月低
LME 锡	24100	23025	-525	-2.18%	23575	-1.99%	5.98%	
LME 镍	17485	15830	-1284	-7.37%	16133	-6.14%	-3.13%	月低

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	79825	1299775	1755	94325	269100	260994
变化	5725	-4300	35	-200	-100	-540

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。