



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

国际期货晨讯速递

2021 年 05 月 11 日星期二

重点新闻

环球经济

- Colonial Pipeline 预计遭到网络攻击的输油管道将在周末前基本恢复全部服务。白宫官员表示输油管没有遭到严重损害，不存在燃油供应短缺问题
- 美国和伊朗在中东地区关系再趋紧张，五角大楼称，一艘美国海岸警卫队舰艇周一在霍尔木兹海峡附近向以「不安全方式」靠近的伊朗快艇予以警告射击
- 印度发现的变异病毒引发世卫组织对疫情快速蔓延的担忧，该国部分新冠患者出现「黑木耳」真菌感染，可造成毁容甚至死亡。中国将在珠峰峰顶设置防疫「隔离线」
- 世界疫苗接种比例最高的塞舌尔表示，截至 5 月 7 日当周，新冠病例数增加了一倍以上
- 铜价突破 1 万美元挡不住多头进场热情，高盛和美国银行等建议投资者增加投入，一些金属 ETF 出现规模前所未有的资金涌入
- 美国商务部据悉拟邀请台积电、通用汽车、英特尔等公司高管参加 5 月 20 日会议，旨在提高晶片危机应对能力
- 摩根大通、德意志银行据悉遭 1MDB 起诉，马来西亚正试图收回与这家丑闻缠身的国有投资基金有关的逾 230 亿美元资产

股指

- 科技股领跌美国股市，随着大宗商品价格走高，市场担忧通胀是否会阻碍美国经济复苏并遏制美股创纪录的涨势。由于对通货膨胀的担忧日益加剧，科技股为主的那斯达克 100 指数重挫 2.6%。特斯拉和苹果位居跌幅榜前列。ARK Innovation ETF 重拾跌势。道琼工业平均价格指数首次短暂突破 35,000 点。标普 500 指数从历史高点回落。E*Trade Financial 的交易和投资产品部门高管 Chris Larkin 表示，「当市场处于高位

时，要记住市场不会只往一个方向移动，经济完全復甦的前景可能已被市场消化，疲软的就业数据或只是短暂遏制了对通胀过热和加息的担忧」。铜价涨至纪录高点，铁矿石期货暴涨逾 10%，进一步增加了对通货膨胀的忧虑。标普 500 指数下跌 1%，报 4188.43 点。道琼工业平均指数下跌 0.1%，报 34742.82 点。那斯达克综合指数下跌 2.6%，报 13401.86 点

外汇

- 美元现货指数小幅下跌，触及 1 月 7 日以来的最低点。美元/日圆上 0.2% 至 108.79，是上周四以来最大涨幅。澳元/美元下跌 0.1% 至 0.7840；抹去了早前高达 0.6% 的涨幅。纽西兰元/美元下跌 0.1% 至 0.7271；早前一度上涨了 0.4%

能源

- 汽油涨势偃旗息鼓，因 Colonial 预计管道数日内恢復服务。汽油期货上涨 0.3%，结算价每加仑 2.1334 美元，一度大涨 4.2%。6 月 WTI 上涨 2 美分，至每桶 64.92 美元。7 月布伦特上涨 4 美分，至每桶 68.32 美元。Colonial Pipeline 表示，其德克萨斯州至新泽西管线的部分区段将逐步上线，全部服务基本上应该能在周末前恢復。这一表态减轻了人们对燃料短缺威胁美国东海岸上下主要人口中心的近期担忧。此次停运对美国的影响将因地区而异，可能导致有的地区燃油淤积、有些地区短期供应短缺。花旗集团的 Eric Lee 在有关此事的网络研讨会上说，鉴于市场预计事态不会持续太久，价格反应到目前为止比较温和；总之，此事对东海岸汽油和柴油看涨，对欧洲汽油看涨，而对美国墨西哥湾沿岸价格则相反

金属

- 令人失望的美国就业数据推动黄金价格达到三个月高点。现货黄金价格上涨 0.3%，至每盎司 1,837.54 美元。纽约商品交易所 6 月交割的黄金期货上涨 0.3%，收于每盎司 1,837.60 美元，为 2 月 10 日以来的最高水平。现货钯金上涨，白银和铂金下跌。上周五公佈的数据显示美国 4 月份新增非农就业人数 26.6 万，低于预期的程度在该数据历史上位居前列；接受彭博调查的经济学家们的预测数字为增加 100 万。明尼阿波利斯联邦储备银行行长 Neel Kashkari 表示，美国劳动力市场仍处在「深渊」中，还需要激进的支持来加速从新冠疫情中復甦。荷兰国际集团驻新加坡的大宗商品策略主管 Warren Patterson 表示，周五大大低于预期的美国就业数据提振了黄金，美元则承受下行压力；虽然这只是一个数据，但它可能会暂时降低减码债券收购的呼声，从而为金价提供一些支持
- 铁矿石行情「非常火热」，动辄 10% 的涨幅助燃大宗商品热潮。新加坡铁矿石期货突破每吨 226 美元，创历史新高。大连铁矿石合约涨停。LME 铜价一度上涨 3.2%，至创纪录的每吨 10,747.50 美元。随后抹去涨幅，收盘下跌 0.3%，至每吨 10,382 美元。铝下跌 0.4%，此前一度上涨 2.5%。儘管分析师并不确定周一铁矿石价格上涨的诱因，但他们列举了一些趋势，包括对央行在全球经济復甦情况下依然保留支持性政策的乐观预期。对中国收紧环境法规的预期增加了看涨铜价的理由，并助长了对钢铁生产商提前购买铁矿石的猜测。这些上涨给原物料价格一年多的上涨行情火上浇油，近几周变得过犹不及，彭博大宗商品现货指数过去 15 天中有 14 天上涨，达到近十年来的最高水平。周一尾盘，包括铜在内的金属价格收窄涨幅，因美元收窄跌幅且美国国债殖利率上升。高盛集团大宗商品分析师在 5 月 7 日的报告中表示，大宗商品资产类别的理想情境似乎正在形成，因全球经济成长走强、工资压力有限以及联储会维持鸽派基调。同一天，疲软的美国就业数据增加了保持刺激政策的理

由。看涨风险是原物料的上涨助带动通货膨胀率升高，最终迫使各国央行收紧货币政策

主要资料

2021 年 05 月 10 日已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
英国 4 月 Halifax 季调后房价指数月率(%)	1.4	--	1.1
欧元区 5 月 Sentix 投资者信心指数	21	14	13.1

2021 年 05 月 11 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
9:30	中国 4 月 CPI 年率(%)	0.9	1	0.4
16:00	中国 4 月 M2 货币供应年率(%)		9.2	9.4
17:00	德国 5 月 ZEW 经济景气指数		71	70.7
	欧元区 5 月 ZEW 经济景气指数		--	66.3
18:00	美国 4 月 NFIB 小型企业信心指数		100.8	98.2

2021 年 05 月 10 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	35000	34611	-18	-0.05%	34668	9.87%	12.03%	年高
小型标准普尔指数	4238.25	4172	-41.8	-0.99%	4183.4	9.36%	10.15%	年高
小型纳斯达克 100 指数	13752	13305.5	-353	-2.57%	13356.75	6.51%	4.50%	月低
富时 100 指数	7143.5	7045	-0.5	-0.01%	7102.5	7.16%	7.98%	年高
德国 DAX	15472	15308	29	0.19%	15409	8.54%	10.25%	周高

富时中国指数	16998	16574	-91	-0.54%	16804	-5.08%	-8.65%	周低
恒生指数	28747	28335	-54	-0.19%	28463	-1.67%	-1.69%	
日经 225	29700	29270	180	0.61%	29570	1.12%	2.86%	周高

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	73.04	72.6	-0.12	-0.16%	72.71	0.95%	1.25%	月高
加元	82.795	82.435	0.29	0.35%	82.66	4.10%	4.84%	年高
澳元	78.92	78.28	-0.055	-0.07%	78.425	1.37%	1.85%	月高
瑞士法郎	111.38	110.96	0.05	0.05%	111.13	2.24%	0.24%	月高
欧元	1.2187	1.2136	-0.00195	-0.16%	1.2154	1.33%	0.70%	月高
英镑	141.59	139.99	1.38	0.99%	141.35	1.46%	2.46%	月高
日元	92.215	91.715	-0.17	-0.18%	91.92	-0.79%	-2.59%	
美元兑人民币	6.4654	6.4204	-0.0435	-0.67%	6.423	-1.05%	-0.85%	年低
美汇指数	90.325	90.015	-0.031	-0.03%	90.185	-1.06%	-0.57%	月低

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	65.75	63.95	0.02	0.03%	64.92	4.10%	12.84%	
布伦特源油	69.2	67.41	0.04	0.06%	68.32	4.33%	12.82%	
天然气	2.971	2.898	-0.026	-0.88%	2.932	10.36%	8.87%	周低
无铅汽油	221.7	211.28	0.65	0.31%	213.34	10.09%	20.80%	年高
低硫柴油	561.25	548	2	0.36%	552.5	5.03%	12.02%	

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	1593.75	1575.25	-2.25	-0.14%	1587.5	12.87%	14.74%	
小麦	760.75	727.25	-31.25	-4.10%	730.5	16.45%	16.38%	
玉米	730.75	708.5	-20.5	-2.80%	711.75	33.91%	35.73%	
原糖 11 号	17.75	17.26	0	0.00%	17.49	8.20%	12.50%	
棉花	89.67	87.07	-1.19	-1.33%	88.47	1.45%	4.47%	
可可	2528	2466	51	2.07%	2514	-1.35%	1.04%	周高

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	1846.3	1830.5	6.3	0.34%	1837.6	6.27%	2.62%	月高

美国白银	28.005	27.32	0.015	0.05%	27.492	5.88%	5.90%	月高
美国铜	488.8	468.75	-3.25	-0.68%	471.6	18.56%	26.87%	年高
美国钯金	3000	2915.5	43.1	1.47%	2968.2	25.01%	26.44%	
美国铂金	1281.4	1250.6	11	0.88%	1265.5	6.66%	9.77%	月高
LME 铝	2603	2505	-9	-0.35%	2531	19.38%	24.85%	年高
LME 铜	10747.5	10310	-35	-0.34%	10382	18.67%	27.15%	年高
LME 铅	2258.5	2206.5	-24	-1.07%	2212.5	11.45%	10.63%	年高
LME 锌	3063	2979	-23.5	-0.78%	2991.5	8.66%	11.23%	年高
LME 锡	30420	29500	-45	-0.15%	29770	20.31%	28.57%	年高
LME 镍	18265	17630	-320	-1.77%	17762	4.84%	2.35%	月高

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	106425	1897300	1780	123775	265825	260208
变化	-850	-6325	-55	-750	-175	426

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，风险承受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確定或不明白的地方，应寻求独立的专业意见。