



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

国际期货晨报速递

2021 年 07 月 28 日星期三

重点新闻 全球经济

- 美国国防部长奥斯汀在访问新加坡期间就南海和新疆等问题抨击中国，但表示不寻求军事对抗
- 美国议员以新疆和香港问题为由，施压可口可乐、Visa 等企业撤销对北京冬奥会的赞助
- 美国经济数据：7 月消费者信心指数连续第六个月上升，达到疫情期间以来新高；6 月耐久财订单成长低于预期；5 月房价再创 30 多年来最大涨幅
- 国际货币基金组织预计，全球经济增速将录得 40 年来最大反弹，但疫苗供应不平等将导致发达经济体与发展中经济体差距扩大
- 欧洲央行管委兼西班牙央行行长称，疫情危机过后仍应保持购债灵活性
- 苹果第三财季营收创纪录，但警告零组件供应紧张将影响当前季度的 iPhone 和 iPad 销售
- 微软连续第十个季度营收及利润超过分析师预期，但投资者担心其 Azure 云计算业务将放缓
- 谷歌母公司 Alphabet 二季度业绩超预期，YouTube 广告收入飙升 84%
- 英国单日新冠死亡人数创 3 月中旬以来的新高，但新增感染连续第七天走低
- 拜登警告称，俄罗斯正试图利用虚假信息干预 2022 年美国中期选举

股指

- 美国股市结束五连涨，苹果和微软等大型科技股在业绩报告发布前下挫。那斯达克 100 指数创逾两个月最大跌幅，三大基准股指均脱离历史新高点。由于传言美国基金抛售中国内地及香港资产，恒生指数周二创下 2020 年 5 月以来最大跌幅。中国市场的暴跌加剧了全球市场的不安，此前由于德尔塔 (delta) 变异株扩散以及有关央行收紧政策的传言，市场已经对经济復甦前景感到担忧。虽然财报发布季的强劲开局提振了美国股市，但投资者仍期待从本周联储会会议以及苹果、微软和 Alphabet Inc. 今日将公佈的业绩中获得更多交易线索。这三家科技巨头周二对标普 500 指数拖累最大。Susquehanna International Group 的衍生品策略联席主管 Chris Murphy 表示，「中国科技股的动盪终于渗透到了美国科技股，在大型科技公司发布业绩前，我们可能还会看到投资者在本周晚些时候获利回吐」。亚马逊和 Facebook 下跌。NYSE FANG+ 指数 10 只成分股裡 9 只下跌，百度和阿里巴巴也走低。标普 500 指数下跌 0.5%，报 4401.46 点。道琼工业平均指数下跌 0.2%，报 35058.52 点。那斯达克综合指数下跌 1.2%，报 14660.58 点

外汇

- 美元汇率指数下跌 0.2%，一度上涨 0.3%。亚太地区 G-10 货币。美元/日圆下跌 0.6%，至 109.71，一度下跌 0.7%，创 7 月 19 日以来最大跌幅。澳元/美元下跌 0.3%，至 0.7365，一度下跌 0.7%。纽西兰元/美元下跌 0.6%，至 0.6962，一度下跌 0.9%

能源

- 油价小幅走低，疫情拖累近期需求前景。纽约原油期货周二下跌 0.4%。高传染性 delta 病毒变种感染病例增加，导致世界各地採取新的限制措施，特别是在疫苗接种率较低的国家。美国卫生官员将在周二晚些时候发布的指南中建议完成疫苗接种的人在室内公共场所戴上口罩。「目前更多的是对市场情绪的打击，」Again Capital LLC 合伙人 John Kilduff 说。「石油市场对疫情發展更加敏感，特别是当疫情恶化时」。美国基准原油期货可能录得 10 月份以来第二个月度下跌，因 delta 变种中断了需求反弹。儘管全球库存料将趋紧到年底，但新的出行限制已经抑制了一些国家的石油消费。纽约商业交易所 9 月 WTI 下跌 26 美分，结算价报每桶 71.65 美元。伦敦 ICE 欧洲期货交易所 9 月布伦特下跌 2 美分，收于每桶 74.48 美元

金属

- 金价持稳，投资者在联储会会前离场观望。现货黄金上涨 0.1% 至每盎司 1,799.92 美元。12 月交割的黄金期货上涨不到 0.1%，结算价报 1,804 美元。现货白银、铂金和钯金下跌。彭博美元即期汇率指数下跌 0.1%。接受彭博调查的经济学家预计，预计联储会明年将开始缩减资产购买，重点缩减 MBS；预计联储会将以快于此前预期的速度加息，直至 2024 年底。金价持稳于每盎司 1,800 美元附近，联邦公开市场委员会周二开始为期两天的会议，投资者离场观望。金价周一一度上扬，受中国股市的波动影响。中国整顿科技行业，打击了市场的风险情绪
- 中国市场暴跌冲击全球，主要基本金属全线走低。镍领跌基本金属，人民币汇率走低使得以美元计价的大宗商品对中国製造商来说显得更加昂贵。交易员们将中国金融市场的普遍下跌归因于中国政府整顿科技行业之际美国基金抛售中国和香港资产的猜测。中国金融市场遭抛售，以及对新冠病毒 delta 变种蔓延影响经济的担忧，都导致基本金属刚刚出现的涨势中断，并且投资者越来越担心，在市场进入季节性疲软期之际，需求可能遭受重创。周三联储会将公佈货币政策会议结果，投资者也在观望未来货币政策走向的线索。「传统上来说，夏季是金属需求的淡

季，这可能促使金属盘整，」Sucden Financial 的分析师在通过电子邮件发布的报告中表示。「Delta 变种病毒的蔓延在金融市场引起了一些紧张情绪，特别是在高通胀的背景下」。伦敦金属交易所镍价一度下跌 2.6% 至每吨 19,215 美元，结算价报 19,357 美元。伦敦金属交易所所有主要金属均走低，铜价下跌 0.5%

主要资料

2021 年 07 月 27 日已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
英国 7 月 CBI 零售销售差值	23	21	25
美国 6 月耐用品订单月率	0.80%	2.10%	3.20%
美国 5 月 FHFA 房价指数月率	1.70%	1.60%	1.80%
美国 5 月 S&P/CS20 座大城市房价指数年率	17.00%	16.40%	15.00%
美国 7 月谘商会消费者信心指数	129.1	123.9	128.9
美国 7 月里奇蒙德联储制造业指数	27	20	26

2021 年 07 月 28 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
4:30	美国至 7 月 23 日当周 API 原油库存(万桶)	-472.8	-343.3	80.6
9:30	澳大利亚第二季度 CPI 年率	3.80%	3.80%	1.10%
14:00	德国 8 月 Gfk 消费者信心指数	-0.3	1	-0.3
	英国 7 月 Nationwide 房价指数月率	-0.50%	0.60%	0.70%
16:00	瑞士 7 月 ZEW 投资者信心指数		--	51.3
20:30	加拿大 6 月 CPI 月率		0.40%	0.50%
22:30	美国至 7 月 23 日当周 EIA 原油库存(万桶)		-292.8	210.7

2021 年 07 月 27 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	35040	34762	-81	-0.23%	34953	1.11%	2.02%	

小型标准普尔指数	4416	4364.75	-19.7	-0.45%	4394.6	1.56%	3.61%
小型纳斯达克 100 指数	15131.5	14774.25	-170	-1.12%	14947.75	2.20%	6.21%
富时 100 指数	6964	6857	-24.5	-0.35%	6927	-0.15%	-0.40%
德国 DAX	15624	15407	-83	-0.53%	15516	0.47%	0.45%
富时中国指数	15705	14536	-713	-4.61%	14740	-4.73%	-8.40%
恒生指数	26372	24743	-1092	-4.18%	25038	-3.68%	-5.91%
日经 225	28020	27640	80	0.29%	27910	-0.75%	-1.85%

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	70.04	69.39	-0.35	-0.50%	69.57	0.39%	-1.02%	
加元	79.755	79.335	-0.28	-0.35%	79.415	-0.03%	-1.78%	
澳元	73.905	73.385	-0.175	-0.24%	73.625	-0.45%	-2.47%	
瑞士法郎	109.67	108.98	0.23	0.21%	109.53	0.64%	-0.38%	周高
欧元	1.18525	1.17805	0.00215	0.18%	1.1834	0.19%	-1.27%	周高
英镑	138.97	137.68	0.73	0.53%	138.89	0.74%	-0.46%	周高
日元	91.29	90.62	0.545	0.60%	91.175	0.65%	0.35%	周高

美元兑人民币	6.5472	6.5006	0.0231	0.35%	6.5323	0.63%	1.11%	月高
美汇指数	92.845	92.32	-0.215	-0.23%	92.436	0.28%	1.50%	周低

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	72.33	71.08	-0.26	-0.36%	71.65	0.54%	3.39%	
布伦特原油	75.05	74.02	-0.02	-0.03%	74.48	1.26%	3.50%	周高
天然气	4.114	3.934	-0.131	-3.19%	3.971	8.70%	19.94%	
无铅汽油	234.02	229.53	0.58	0.25%	231.41	3.64%	5.98%	年高
低硫柴油	605.25	596.75	0.5	0.08%	600.5	1.18%	2.52%	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	1387.5	1355.5	1.75	0.13%	1359.5	1.73%	1.63%	
小麦	690	671.75	-2.5	-0.37%	674.5	3.87%	3.15%	
玉米	560.75	542.25	-0.5	-0.09%	546.25	1.60%	0.63%	
原糖 11 号	18.73	18.26	-0.07	-0.38%	18.35	6.23%	7.51%	年高
棉花	90.5	89.21	0.63	0.70%	90.23	2.43%	4.64%	

可可	2407	2373	1	0.04%	2393	2.88%	0.42%
----	------	------	---	-------	------	-------	-------

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	1809.5	1796.9	0.6	0.03%	1804	0.14%	-1.53%	
美国白银	25.32	24.515	-0.669	-2.64%	24.649	-1.67%	-5.30%	月低
美国铜	462.75	450.5	-4.05	-0.88%	454.45	6.75%	4.97%	月高
美国钯金	2670	2587.5	-71.4	-2.67%	2606.7	-2.29%	-2.67%	周低
美国铂金	1069.2	1044	-20.5	-1.92%	1049.5	-1.58%	-4.88%	
LME 铝	2525	2479.5	-29	-1.15%	2490	0.96%	2.39%	
LME 铜	9924	9656.5	-51	-0.52%	9758.5	5.18%	2.86%	月高
LME 铅	2371.5	2330	-34	-1.43%	2338.5	2.29%	5.79%	
LME 锌	3023	2952.5	-28.5	-0.95%	2982.5	2.23%	1.85%	月高
LME 锡	34990	34215	-410	-1.18%	34375	6.94%	11.39%	年高
LME 镍	19795	19215	-360	-1.83%	19357	6.02%	9.01%	月高

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	225225	1408000	2315	61775	247000	217878
变化	0	-8775	-35	-225	-200	-1302

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确定或不明白的地方，应寻求独立的专业意见。

