



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

国际期货晨讯速递

2021年07月29日星期四

重点新闻

环球经济

- 联储会维持利率及资产购买计画不变，主席鲍威尔称经济朝着支持减码的方向取得进展，但是还有一段路要走
- 美国周四将公佈二季度 GDP 数据，预计折合成成年率成长 8.5%，仍然保持高速，但德尔塔变异毒株的扩散带来了消费前景的不确定性
- 因石油等商品进口增加，美国 6 月份商品贸易逆差扩大至历史次高水平
- 美国参议院负责基础设施法案磋商的一个两党小组达成协议，标志着国会在大规模基建投入立法方面取得重大突破
- 美国商务部长反驳高通膨将持续的观点，并称部分进口关税「非常有效」，如果中国不遵守规则，就适合徵收关税
- 商务部长：拜登将就是否向外国晶片製造商提供补贴作出决定，美国非常依赖台湾晶片
- 新冠疫情追踪：东京单日新增确诊再创新高，据报日本考虑宣布大坂及东京周边三个县进入疫情紧急状态。病毒在美国国会也卷土重来
- 全球最大铜矿面临罢工风险，工会建议拒绝资方必和必拓给出的工资方案
- 由美国前财长盖特纳领导的一个委员会敦促美债市场改革，以免再度發生去年那种崩溃

股指

- 美国股市周三标普 500 指数收盘基本持平，国债殖利率下跌，此前联储会将利率维持在零附近不变，主席杰罗姆·鲍威尔表示，儘管经济取得了进展，但距离加息还有「一段路要走」。那斯达克 100 指数和标普 500 指数在联储会声明發布后走高；Alphabet Inc. 公佈的销售业绩好于预

期，给上述两个指数带来了最大的提振。苹果公司股价下跌 1.2%，拖累了标普 500 指数的表现。道琼工业平均指数下跌，麦当劳在业绩发布后下跌给该指数带来沉重压力。10 年期美国国债殖利率下跌 1 个基点至 1.23%，此前一度攀升至 1.27% 的高位。虽然强劲的盈利一直在增强市场对企业复甦的信心，但投资者仍然对 Covid-19 delta 变种对全球成长的威胁以及货币政策收紧的可能性感到紧张。联储会周三在为期两天政策会议后发布的声明中将基准政策利率维持在接近零的水平，并重申通胀率持续低于 2% 的长期目标。「虽然经济似乎越来越接近，但联储会尚未看到足够强的数据使其有必要进行实质性的政策调整，」AXS Investments LLC 执行长 Greg Bassuk 说。「因此，我们预计市场短期内将保持波动，主要受到本季度剩餘的企业财报，即将发布的关键经济数据，以及全球遏制疫情方面进展的推动」。有关参议院两党团体就广泛的基础设施计划达成协议的消息提振了卡特彼勒和 Vulcan Materials 等股票，后者股价一度上涨 4%，为 5 月份以来最大涨幅。在美国上市的大型中资股反弹，此前中国官方媒体试图安抚投资者；中国证券监管机构周三晚间召集主要投资银行的高管召开虚拟会议，试图缓解市场对政府整顿民营教育行业的担忧。根据彭博汇编的数据，到目前为止，公布第二季度业绩的标普 500 指数成份股公司中，几乎 90% 的公司业绩超出了分析师的盈利预测。标普 500 指数基本持平，报 4400.64 点。道琼工业平均指数下跌 0.4%，报 34930.93 点。那斯达克综合指数上涨 0.7%，报 14762.58 点

外汇

- 美元汇率指数下跌 0.2%，处于 7 月 15 日以来最低水平；一度上涨 0.3%。亚太地区 G-10 货币。美元/日圆上涨 0.1%，至 109.87，一度上涨 0.5%。澳元/美元上涨 0.2%，至 0.7374，一度下跌 0.6%。纽西兰元/美元基本持平，报 0.6957；一度下跌 0.8%

能源

- 油价上涨，因美国库存在需求旺季下降。纽约原油期货周三上涨 1%。美国政府的一份报告显示原油库存跌至 2020 年 1 月以来最低，馏分油库存创 4 月以来最大降幅。数据显示，上周汽油库存减少逾 200 万桶。Tortoise 的投资组合经理 Brian Kessens 说，从库存角度来看，美国的需求相当健康；虽然 delta 病毒变种值得关注，但在美国「到目前为止，它对出行没有任何影响」。纽约商业交易所 9 月 WTI 上涨 74 美分，结算价报每桶 72.39 美元。伦敦 ICE 欧洲期货交易所 9 月布伦特上涨 26 美分，收于每桶 74.74 美元

金属

- 金价在联储会会议后走势不定；基本金属涨跌互见。「美国经济已经朝着这些目标取得进展，委员会将在未来的会议上继续评估进展，」联邦公开市场委员会周三在声明中表示。鲍威尔在会后的新闻发布会上称，官员们在会议上讨论了减码情境，将基于数据做出决定；他还表示，经济复甦还没有取得「实际性进一步进展」，要达到该目标还有一些距离，他「希望看到一些强劲的就业数据」。Sprott Asset Management 的市场策略师 Paul Wong 表示，看起来正在缓慢迈向减码，但就业方面还有一些距离；他预计债市殖利率不会有太大变化，这将使美元成为金价的主要驱动力。FOMC 声明发布后，现货黄金价格一度下跌 0.4%，但随后收復跌幅，上涨 0.5% 至每盎司 1,807.33 美元。在联储会政策声明公布前，由于投资者等待联储会减码刺激的更多线索，基本金属涨跌互见。国际货币基金组织继续预测全球经济增速将取得 40 年来最大反弹，但因开发中国家获取疫苗的机会不均衡而调整了区域成长预测。伦敦金属交易所铜价下跌 0.7%，收于每吨 9,686 美元；铝和镍价上涨

主要资料

2021年07月28日已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
美国至7月23日当周API原油库存(万桶)	-472.8	-343.3	80.6
澳大利亚第二季度CPI年率	3.80%	3.80%	1.10%
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%
瑞士7月ZEW投资者信心指数	42.8	--	51.3
加拿大6月CPI月率	0.30%	0.40%	0.50%
美国至7月23日当周EIA原油库存(万桶)	-408.9	-292.8	210.7

2021年07月29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
2:00	美国至7月28日美联储利率决定(上限)	0.25%	0.25%	0.25%
15:55	德国7月季调后失业人数(万人)		-2.8	-3.8
	德国7月季调后失业率		5.80%	5.90%
16:30	英国6月央行抵押贷款许可(万人)		8.61	8.75
17:00	欧元区7月工业景气指数		13	12.7
	欧元区7月消费者信心指数终值		-4.4	-4.4
	欧元区7月经济景气指数		118.5	117.9
20:00	德国7月CPI月率初值		0.50%	0.40%
20:30	美国至7月24日当周初请失业金人数(万人)		38	41.9
	美国第二季度实际GDP年化季率初值		8.50%	6.40%
	美国第二季度实际个人消费支出季率初值		--	11.40%
	美国第二季度核心PCE物价指数年化季率初值		5.90%	2.50%
22:00	美国6月成屋签约销售指数月率		0.30%	8.00%
22:30	美国至7月23日当周EIA天然气库存(亿立方英尺)		430	490

2021年07月28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	35018	34764	-119	-0.34%	34834	1.01%	1.91%	
小型标准普尔指数	4407.75	4377.5	-0.8	-0.02%	4393.8	1.26%	3.29%	
小型纳斯达克 100 指数	15074.5	14866	63.75	0.43%	15011.5	1.65%	5.54%	
富时 100 指数	6955.5	6903.5	23.5	0.34%	6950.5	-0.21%	-0.53%	
德国 DAX	15577	15474	45	0.29%	15561	0.18%	0.12%	
富时中国指数	15327	14728	528	3.58%	15268	-6.49%	-10.39%	
恒生指数	25594	24871	346	1.38%	25384	-6.09%	-8.59%	
日经 225	27840	27350	-380	-1.36%	27530	-1.18%	-2.42%	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	69.68	69	-0.09	-0.13%	69.48	-0.10%	-1.44%	周低
加元	79.9	79.335	0.39	0.49%	79.805	0.17%	-1.54%	周高
澳元	73.83	73.18	0.07	0.10%	73.695	-0.47%	-2.46%	周低
瑞士法郎	110.03	109.21	0.37	0.34%	109.9	0.87%	-0.02%	月高

欧元	1.1861	1.1783	0.00155	0.13%	1.18495	0.25%	-1.13%	周高
英镑	139.15	138.44	0.19	0.14%	139.08	0.82%	-0.29%	月高
日元	91.155	90.7	-0.22	-0.24%	90.955	0.45%	0.23%	
美元兑人民币	6.555	6.5303	0.0008	0.01%	6.5331	0.74%	1.22%	月高
美汇指数	92.785	92.235	-0.119	-0.13%	92.317	0.24%	1.38%	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	72.6	71.7	0.74	1.03%	72.39	0.90%	3.54%	周高
布伦特原油	75.32	74.42	0.26	0.35%	74.74	1.69%	3.58%	周高
天然气	4.025	3.837	0.025	0.63%	3.967	6.43%	17.23%	周低
无铅汽油	233.28	229.98	-0.59	-0.25%	230.82	3.20%	5.50%	
低硫柴油	605.75	599.5	0.5	0.08%	601	1.30%	2.42%	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	1371	1350.5	1.5	0.11%	1361	0.68%	0.49%	
小麦	696.25	673.75	14.25	2.11%	688.75	4.60%	4.07%	

玉米	552.5	542.75	2.75	0.50%	549	0.44%	-0.88%	
原糖 11 号	18.69	18.1	0.26	1.42%	18.61	5.69%	7.09%	
棉花	91	89.91	0.29	0.32%	90.52	2.68%	5.05%	年高
可可	2446	2376	34	1.42%	2427	4.47%	2.17%	月高

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	1813.9	1795.6	0.6	0.03%	1804.6	0.27%	-1.23%	
美国白银	25.06	24.655	0.228	0.92%	24.877	-2.50%	-6.06%	
美国铜	458.75	442.95	-6.25	-1.38%	448.2	5.70%	4.22%	
美国钯金	2634.5	2583	15.9	0.61%	2622.6	-3.35%	-3.78%	周低
美国铂金	1068	1044.6	8.6	0.82%	1058.1	-1.69%	-4.72%	
LME 铝	2544.5	2476	47	1.89%	2537	1.71%	3.13%	周高
LME 铜	9830.5	9654	-72.5	-0.74%	9686	4.02%	2.04%	
LME 铅	2358	2324	5	0.21%	2343.5	1.56%	5.08%	周低
LME 锌	2989	2948	-3	-0.10%	2979.5	1.07%	0.76%	
LME 锡	34725	34380	25	0.07%	34400	5.62%	10.27%	

LME 镍	19785	19370	186	0.96%	19543	5.59%	8.77%
-------	-------	-------	-----	-------	-------	-------	-------

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	230225	1401500	2365	61400	246950	215820
变化	5000	-6500	50	-375	-50	-2058

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。