



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

国际期货晨讯速递

2021年08月04日星期三

重点新闻

环球经济

- 新冠疫情追踪：美国传染病学会警告 delta 变异病毒的传播已将群体免疫门槛推高至 80% 以上；纽约市将要求餐厅健身房等室内场所顾客出示疫苗接种证明
- 联储会理事 Bowman 称招聘速度令人鼓舞，但就业人数远低于疫情前水平；旧金山联储行长 Daly 预计失业者将重返劳动力市场
- 全球大银行在疫情中盈利 1,700 亿美元，创下有史以来最赚钱的一年。高盛和摩根士丹利双双打破自身盈利纪录，瑞银和巴克莱的利润都创十年来最高水平
- 微软推迟办公室重开时间，要求员工必须接种疫苗方可进入美国办公室
- 美国证券交易委员会（SEC）主席 Gary Gensler 暗示了一条批准设立比特币 ETF 的途径，表示符合 SEC 关于共同基金严格规则的 ETF 能给投资者提供必要的保护
- 知情人士透露，英国因潜在国家安全风险考虑阻止英伟达收购 Arm
- 美国副总统哈里斯将在本月晚些时候访问东南亚，解决供应链问题将是此行重点
- 纽约州司法部长表示，该州州长库莫涉嫌性骚扰多名女性，在办公室裡製造「恐惧气氛」，触犯了联邦和州法律。库莫对上述指控提出反驳
- 以色列称已向盟友提供确凿证据，显示伊朗是阿曼湾油轮袭击事件肇事者

股指

- 美国股市周二上涨，因多数企业财报表现积极，盖过对中国整顿互联网行业及 delta 疫情的担忧。标普 500 指数上涨并收在纪录新高，Ralph Lauren Corp.、Gartner Inc. 和 Under Armour Inc. 发布财报后纷纷上扬。与此同时，那斯达克 100 指数也扳回跌幅。稍早在中国官媒批评网络游戏为「精神鸦片」及英国据称考虑阻止英伟达以 400 亿美元收购 Arm Ltd. 后，那斯达克 100 指数下跌。中概股游戏相关个股重挫，网易、哔哩哔哩、虎牙和斗鱼均跌逾 7%。油价扳回部分跌幅，推动能源股走高。早些时候，关于纽约市将要求餐厅健身房等室内场所顾客出示疫苗接种证明的消息一度使市场下跌。「我认为人们将继续看到这种持续的波动。一段时间以来，造成波动的主要焦点是到底有没有通膨，」 TD Ameritrade 首席市场策略师 JJ Kinahan 接受采访时表示。「本周焦点是良好的业绩跟疫情，经济重启会因疫情而暂停吗？」企业二季度财报大多表现强劲，但几个月来美国国债一直在上涨，可能预示着前景疲软。交易员正等待本周公布的非农就业数据，以此评估经济复甦状况，并密切关注疫情造成的干扰对价格压力有何影响。「最近几周和几个月是股市动盪不安的时候，」 All Star Charts 投资策略师 Willie Delwiche 表示。「美国大型股指数震盪走高，而在表象之下，震盪行情有下行倾向。对向上或向下突破的强烈信念都还没得到回报」。标普 500 指数上涨 0.8%，报 4423.15 点。道琼工业平均指数上涨 0.8%，报 35116.4 点。那斯达克综合指数上涨 0.6%，报 14761.29 点

外汇

- 美元汇率指数下跌 0.1%，一度下跌 0.2%* 亚太地区 G-10 货币。美元/日圆下跌 0.2%，至 109.06，一度触及 108.88，为 5 月 26 日以来最低。澳元/美元上涨 0.5%，至 0.7396，一度上涨 0.6%。纽西兰元/美元上涨 0.7%，至 0.7016；纽西兰央行的楼市降温措施令紧缩预期升温

能源

- 油价两日连跌，因中国近期疫情令市场担忧需求前景。油价周二连续第二天下跌，因 Delta 引起的疫情在原油需求大国中国蔓延，可能颠复全球消费复甦势头。西德克萨斯中质油收跌 1%，触及近两周收盘低点；在短短两周内，中国近期出现的疫情已波及近一半行政区域。据中国石油估算，这一轮疫情可能会抹掉 5% 的短期石油需求。股市上涨和阿曼湾邮轮「潜在劫持」事件一定程度上缓冲了油价跌势。「稍早油价下跌是因为中国因疫情重新实施防疫限制，引发需求担忧，」 Price Futures Group 高级市场分析师 Phil Flynn 表示「市场很担心中国疫情形势，」 Again Capital LLC 合伙人 John Kilduff 表示。「作为重要需求中心，如果中国有问题，影响会很大」「亚太地区目前是防疫封锁焦点，」 Raymond James & Associates Inc. 分析师 Pavel Molchanov 表示。「目前全球有 8.87 亿人处于封锁状态，多于 2021 年初，其中 85% 在亚太地区」。美国基准原油期货面临技术压力。WTI 跌破 50 日移动均线，正在逼近 100 日移动均线。这样的走势通常会引发趋势基金进一步的抛盘。WTI 9 月交割原油期货下跌 70 美分，结算价报每桶 70.56 美元。布伦特 10 月交割原油期货下跌 48 美分，至每桶 72.41 美元

金属

- 金价小幅下跌，投资者等待美国就业数据以寻找政策线索。黄金小幅走低，投资者等待本周将公布的一份重要就业报告来研判联储会货币政策路径的线索。交易员们将密切关注定于周五公布的非农就业报告。联储会理事 Christopher Waller 周一表示，如果美国未来两个月数据显示就业持续成长，他可能会支持儘早就缩减购债规模发布声明。Oanda Corp. 高级市场分析师 Edward Moya 表示，「对于许多黄金交易员来说，问题是联储会会在 9 月还是年底减码」「联储会似乎已经锁定了基于结果的方法，这应该意味着减码将发生在年底」。最近几周，金价一直在每盎司 1,800 美元左右窄幅波动。德国商业银行分析师 Daniel Briesemann 表示，随着 100 天和 200 天移动均线接近收敛，市场很快将不得不「决

定」前进方向。他表示，10年期美国国债的实际殖利率接近纪录低点，表明黄金价格有望上涨。现货黄金跌0.1%至每盎司1,811.12美元。Comex 12月交割黄金期货下跌0.4%，结算价报每盎司1,814.10美元。现货白银上涨，铂金和钯金下跌

- 锌价领跌基本金属，制造业放缓打击了市场信心。锌价周二领跌基本金属，中国钢铁市场下跌对作为生产原物料的锌带来压力，另外新冠疫情蔓延带来的风险也抑制了投资者对大宗商品的兴趣。由于Delta变种病毒感染病例不断增加，中国的疫情防控正受到考验；随着当局加大抗疫力度，大宗商品受到冲击。由于上海期货交易所的钢铁期货面临压力，用于防鏽的锌创出六周多以来最大跌幅。铜价连续第三天下跌，此前有报导显示美国和中国制造业成长放缓。「工业金属越来越感受到美国和中国经济同时放缓的影响，」道明证券分析师Bart Melek等人的一份报告中表示。伦敦金属交易所锌价一度下跌3%至每吨2,960美元，结算价跌2.7%至2,969.50美元。LME所有其他主要金属均走低，铜下跌1.6%

主要资料

2021年08月03日已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
澳大利亚至8月3日3年期国债收益率目标	0.10%	0.10%	0.10%
澳大利亚至8月3日澳洲联储利率决定	0.10%	0.10%	0.10%
瑞士第三季度消费者信心指数	7.8	-5.3	-6.5
欧元区6月PPI月率	1.40%	1.40%	1.30%
美国6月工厂订单月率	1.50%	1.00%	2.30%

2021年08月04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30日当周API原油库存(万桶)	-87.9	-140	-472.8
9:45	中国7月财新服务业PMI	54.9	50.5	50.3
15:50	法国7月服务业PMI终值		57	57
15:55	德国7月服务业PMI终值		62.2	62.2
16:00	欧元区7月服务业PMI终值		60.4	60.4
16:30	英国7月服务业PMI		57.8	57.8
17:00	欧元区6月零售销售月率		1.70%	4.60%
20:15	美国7月ADP就业人数(万人)		69.5	69.2
21:45	美国7月Markit服务业PMI终值		59.8	59.8
22:00	美国7月ISM非制造业PMI		60.5	60.1

2021 年 08 月 03 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	35009	34602	277	0.80%	34998	0.77%	1.66%	周低
小型标准普尔指数	4417	4365.25	35.4	0.81%	4415.1	1.15%	3.00%	周低
小型纳斯达克 100 指数	15050	14849	93.5	0.63%	15046.25	1.06%	4.44%	
富时 100 指数	7054.5	6991	22	0.31%	7036.5	1.30%	0.79%	周高
德国 DAX	15596	15481	-34	-0.22%	15544	0.32%	0.17%	
富时中国指数	15526	15247	93	0.60%	15477	-3.30%	-8.04%	
恒生指数	26228	25703	-66	-0.25%	26055	-2.61%	-6.03%	
日经 225	27820	27460	-160	-0.58%	27580	-0.48%	-2.35%	

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	70.19	69.69	0.4	0.57%	70.14	0.59%	-0.53%	
加元	80.06	79.51	-0.18	-0.23%	79.76	0.48%	-1.07%	
澳元	74.1	73.58	0.295	0.40%	73.955	0.18%	-1.72%	

瑞士法郎	110.94	110.52	0.11	0.10%	110.72	1.25%	0.86%	月高
欧元	1.1903	1.18625	-0.00105	-0.09%	1.1872	0.54%	-0.56%	
英镑	139.4	138.84	0.24	0.17%	139.17	0.81%	0.02%	
日元	91.875	91.485	0.115	0.13%	91.68	0.92%	1.04%	月高
美元兑人民币	6.4939	6.48	0.0014	0.02%	6.4829	-0.12%	0.25%	
美汇指数	92.16	91.895	0.023	0.02%	92.088	-0.33%	0.51%	

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	71.96	69.19	-0.7	-0.98%	70.56	0.42%	1.63%	周低
布伦特源油	73.55	71.05	-0.48	-0.66%	72.41	0.61%	1.42%	周低
天然气	4.077	3.915	0.092	2.34%	4.027	5.61%	16.01%	
无铅汽油	230.33	223.37	-0.39	-0.17%	227.08	2.29%	4.16%	周低
低硫柴油	602	582.5	-4.5	-0.75%	591.75	0.83%	1.22%	周低

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	1348	1308.75	-33.75	-2.49%	1319.75	-0.78%	-1.06%	周低

小麦	734.75	717.75	-5	-0.69%	724.5	7.72%	9.19%	月高
玉米	565.25	547.25	-7.5	-1.34%	551.75	2.97%	1.27%	周高
原糖 11 号	18.24	17.74	0.03	0.17%	17.98	3.06%	4.08%	周低
棉花	90.1	89.03	0.24	0.27%	89.87	1.05%	3.35%	
可可	2433	2361	63	2.67%	2426	3.40%	2.02%	

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	1818.2	1809.5	-8.1	-0.44%	1814.1	0.20%	-0.71%	
美国白银	25.665	25.27	0.007	0.03%	25.582	0.23%	-3.16%	
美国铜	444.25	433.85	-4.7	-1.06%	438.6	1.61%	1.14%	周低
美国钯金	2708.5	2634.5	-38.8	-1.45%	2645.3	0.42%	-0.59%	周高
美国铂金	1055.4	1036.3	-9.4	-0.89%	1046.9	-2.21%	-4.87%	
LME 铝	2617.5	2583	-29	-1.11%	2586	4.16%	5.39%	
LME 铜	9691	9485	-159	-1.64%	9541.5	1.86%	0.82%	周低
LME 铅	2404	2364	-4	-0.17%	2398	2.66%	6.34%	
LME 锌	3035	2960	-81	-2.66%	2969.5	2.12%	2.15%	

LME 锡	34935	34275	-193	-0.55%	34637	4.22%	9.50%	周低
LME 镍	19500	19125	-128	-0.66%	19388	2.58%	6.05%	周低

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍
库存	238000	1371150	2290	59375	244950	211068
变化	-650	-7425	0	-375	-75	-2052

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确定或不明白的地方，应寻求独立的专业意见。