



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

国际期货晨讯速递

2021年10月18日星期一

重点新闻

环球经济

- 美国9月份零售销售意外成长，而消费者信心指数降至十年来倒数第二低，通膨担忧持续升温
- 利率掉期显示，联储会明年6月加息25个基点的机率上升至近50%，9月加息25个基点的机率为百分百
- 欧洲央行总裁拉加德称，通膨「很大程度上是暂时的」，央行将继续支持经济
- 法国央行行长称，欧洲央行应该创建一个「或有选项」来保持应对危机的量化宽松计划的灵活性，同时这个选项不必构成传统购债工具的一部分
- 英国央行行长贝利称，英国通膨可能持续更久，增强了加息理由
- 比特币一路狂飙逼近历史高位，本月涨幅超过40%。申报文件显示，资产管理公司ProShares计划最早周一推出美国首个比特币期货ETF
- 德国财长朔尔茨清除了他出任德国总理的主要障碍，从潜在合作伙伴那裡获得了组建三方联合政府的初步承诺
- 知情人士透露，距离关键的罗马峰会召开还有两周之际，G-20官员在上周举行的预备会谈未能就应对气候变化的具体措施达成协议
- 高盛今年前三季度营收已经超过去年全年水平，交易业务收入成长23%，固收交易部门的业绩轻松超过预期
- 美国11月8日起向接种疫苗的外国人开放，取代对包括中国在内的旅行禁令

股指

- 美国股市创下 7 月以来最大周涨幅，企业盈利强劲和零售销售意外成长提振了那些更可能从经济反弹中受益的公司股价。密歇根大学 10 月初消费者信心指数创十年来倒数第二低，但这似乎没有对股市产生影响。零售、银行、工业板块领涨标普 500 指数。高盛走高，此前该行公布交易业务成长超出分析师预期。高盛今年业绩稳创历史新高 交易部门是最大功臣。创纪录利润推动证券经纪商嘉信理财股价飙升。货运巨头 JB Hunt Transport Services Inc. 和美国铝业走高， 两家公司的业绩均好于预期。「我们认为做多股票是最好的做法，金融，工业，能源、材料等周期性股票有望进一步上涨，」 Instant Advisor Alliance 首席投资官 Chris Zaccarelli 表示。「公用事业和消费必需品板块将面临利率和通胀上升带来的阻力」。高盛集团执行长 David Solomon 表示，通胀，尤其是工资上涨，仍然是企业领导者和股东关注的头等大事。华尔街大佬纷纷表达通胀之忧：这「显然不是暂时的」。标普 500 指数上涨 0.8%，报 4471.37 点。道琼工业平均指数上涨 1.1%，报 35294.76 点。那斯达克综合指数上涨 0.5%，报 14897.34 点

外汇

- 美元汇率指数下跌 0.1%，连续第三天下跌。亚太地区 G-10 货币。美元/日圆上涨 0.5%，至 114.21。澳元/美元上涨 0.1%，至 0.7421。纽西兰元/美元上涨 0.5%，至 0.7070

能源

- 布伦特油价自 2018 年来首次升穿 85 美元，因能源危机刺激需求。布伦特原油期货自 2018 年以来首次突破每桶 85 美元，成为全球能源危机中最新一座里程碑。布伦特原油期货盘中升穿了 85 美元，但收盘回落到这道关口下方。美国原油期货连续第八周上涨，为 2015 年以来最长按周连涨纪录。天然气和煤炭短缺导致电力市场对石油产品需求上升，并消耗了库存：在美国最大仓储中心库欣，本周库存出现不同于往年同期的大幅异常下降。与此同时，美国表示将允许完全接种了新冠疫苗的外国旅客入境，进一步表明随着经济从疫情中反弹，需求会更强。「进入冬季有更多全球能源供应紧张迹象」，这对油价形成了支撑，Price Futures Group Inc 高级市场分析师 Phil Flynn 表示。西德克萨斯中质油 11 月交割原油期货上涨 97 美分，结算价报每桶 82.28 美元。布伦特 12 月交割原油期货上涨 86 美分，结算价报每桶 84.86 美元

金属

- 基本金属继续飙升，因能源危机引发更多限产。基本金属继续大幅攀升，因能源短缺导致更多减产发生并使制造商承受越来越大的压力。从锌、铝到钢铁在内的生产商都因电力限制或能源成本上涨而限产。最新一家是头号锌生产商嘉能可，由于电价飙升，该公司三家欧洲工厂限产。伦敦金属交易所(LME)锌价一度上涨 12%，创下 2015 年 10 月以来最大涨幅。铝价也上涨，涨幅扩大至 60%。铜价突破每吨 10,000 美元，并创 2016 年来最大单周涨幅；随着复甦和供应中断导致全球库存萎缩，现货溢价扩大。上日 LME 基本金属指数创下纪录新高。「在能源危机加剧的情况下，基本金属上涨，而且日益升温的通胀担忧正重新激发投资者的热情，」 ING 高级大宗商品策略师 Wenyu Yao 表示。「对通胀的担忧可能会增加对金属的需求，因为人们认为可借此对冲通胀，铜尤其是这样。与此同时，美国实际利率及美元贸易加权指数过去几天回落，也推动了基本金属动能」。「由于大多数金属处于现货溢价状态，实物需求较高，因此价格仍有大幅上涨空间，最明显的是铝和锌，但也渗透到了铜和锡市场，」 Panmure Gordon 分析师 Kieron Hodgson 表示。「这种价格走势越来越可能持续到整个第四季度，然后回落」。LME 锌收涨 7.5%，至每吨 3,794.50 美元。其它主要金属全线上涨，铝上涨 1.7%，铜上涨 3%。黄金价格下跌，因美债殖利率随风险偏好改善而反弹，同时

投资者继续权衡经济刺激前景。12月交割黄金期货收跌1.7%至每盎司1,768.30美元。现货黄金下跌1.57%至1767.62美元

主要资料

2021年10月15日已公布经济资料

主要资料	公布数值	预估数据	前值
法国9月CPI月率	-0.20%	-0.20%	-0.20%
欧元区8月季调后贸易帐(亿欧元)	111	142	134
加拿大8月批发销售月率	0.30%	0.50%	-2.10%
美国9月零售销售月率	0.70%	-0.20%	0.90%
美国10月纽约联储制造业指数	19.8	27	34.3
美国9月进口物价指数月率	0.40%	0.60%	-0.30%
美国8月商业库存月率	0.60%	0.60%	0.60%
美国10月密歇根大学消费者信心指数初值	71.4	73.1	72.8

2021年10月18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
	中国9月本年迄今全国发电装机容量(万千瓦)		--	228254
	中国9月本年迄今全国发电装机容量年率		--	9.50%
10:00	中国第三季度GDP年率	4.90%	5.20%	7.90%
21:15	美国9月工业产出月率		0.20%	0.40%
22:00	美国10月NAHB房产市场指数		76	76

2021年10月15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	35198	34787	387	1.11%	35171	2.33%	1.34%	月高
小型标准普尔指数	4467.5	4426.25	33.5	0.76%	4462.5	2.08%	0.94%	周高

小型纳斯达克 100 指数	15145	15020.75	97.25	0.65%	15134.5	1.67%	0.00%	周高
富时 100 指数	7222	7184.5	20.5	0.29%	7210.5	2.22%	2.26%	年高
德国 DAX	15598	15447	127	0.82%	15569	1.91%	0.19%	周高
富时中国指数	16068	15833	53	0.33%	16045	4.21%	4.98%	
恒生指数	25337	24860	408	1.64%	25318	3.10%	-0.04%	
日经 225	29150	28590	550	1.93%	29120	0.80%	1.98%	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	70.725	70.24	0.42	0.60%	70.645	1.46%	1.07%	周高
加元	81.055	80.655	-0.105	-0.13%	80.745	1.93%	2.23%	月高
澳元	74.42	74.06	0.025	0.03%	74.22	1.88%	1.79%	月高
瑞士法郎	108.6	108.09	0.07	0.06%	108.52	0.51%	-0.12%	
欧元	1.16315	1.16005	0.00065	0.06%	1.16185	-0.04%	-0.88%	
英镑	137.74	136.68	0.64	0.47%	137.5	1.10%	0.40%	周高
日元	88.01	87.395	-0.46	-0.52%	87.555	-1.61%	-2.68%	年低
美元兑人民币	6.4689	6.4515	-0.0046	-0.07%	6.4596	-0.31%	-0.59%	月低

美汇指数	94.07	93.85	-0.023	-0.02%	93.938	0.18%	0.91%	
------	-------	-------	--------	--------	--------	-------	-------	--

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	82.66	81.39	0.97	1.19%	82.28	6.89%	15.12%	年高
布伦特源油	85.1	84.16	0.86	1.02%	84.86	5.76%	14.03%	年高
天然气	5.789	5.4	-0.277	-4.87%	5.41	4.99%	18.00%	
无铅汽油	248.88	243.2	5.14	2.11%	248.64	9.13%	16.27%	年高
低硫柴油	749.75	737.25	19.25	2.65%	746.75	8.41%	18.46%	年高

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	1221	1202	11.5	0.95%	1217.75	-2.15%	-4.96%	
小麦	740.5	722.25	9.25	1.28%	734	1.73%	1.87%	
玉米	528.5	514.25	9	1.74%	525.75	-0.26%	-1.31%	
原糖 11 号	19.97	19.59	0.21	1.07%	19.8	0.26%	-0.54%	
棉花	111.1	106.45	0.23	0.21%	107.33	7.36%	14.12%	
可可	2617	2565	23	0.89%	2607	-1.16%	-0.25%	周低

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	1797.7	1765.1	-29.6	-1.65%	1768.3	2.03%	1.14%	
美国白银	23.645	23.1	-0.128	-0.55%	23.349	4.26%	1.59%	周高
美国铜	478.1	460.35	9.8	2.12%	472.95	10.76%	11.26%	月高
美国钯金	2156	2063.5	-74.3	-3.45%	2076.6	9.12%	-1.91%	
美国铂金	1062.9	1043.6	6.6	0.63%	1058.9	7.01%	7.48%	
LME 铝	3215	3091	54.5	1.75%	3171.5	8.80%	14.97%	年高
LME 铜	10328.5	9963	297	2.97%	10281	10.59%	10.31%	月高
LME 铅	2368	2281.5	37.5	1.63%	2337.5	8.75%	5.68%	月高
LME 锌	3944	3500	266	7.54%	3794.5	25.40%	28.51%	年高
LME 锡	37500	36875	277	0.75%	37200	5.88%	8.80%	年高
LME 镍	20120	19235	726	3.76%	20020	7.15%	5.22%	周高

伦敦金属交易所库存

	铜	铝	锡	铅	锌	镍

库存	181400	1118325	925	48400	188650	146022
变化	-5650	-8225	45	-225	-950	-270

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。