

海期快訊

2024年2月5日 永豐期貨顧問事業部編制

美國就業數據超預期強勁 美債殖利率全面跳高

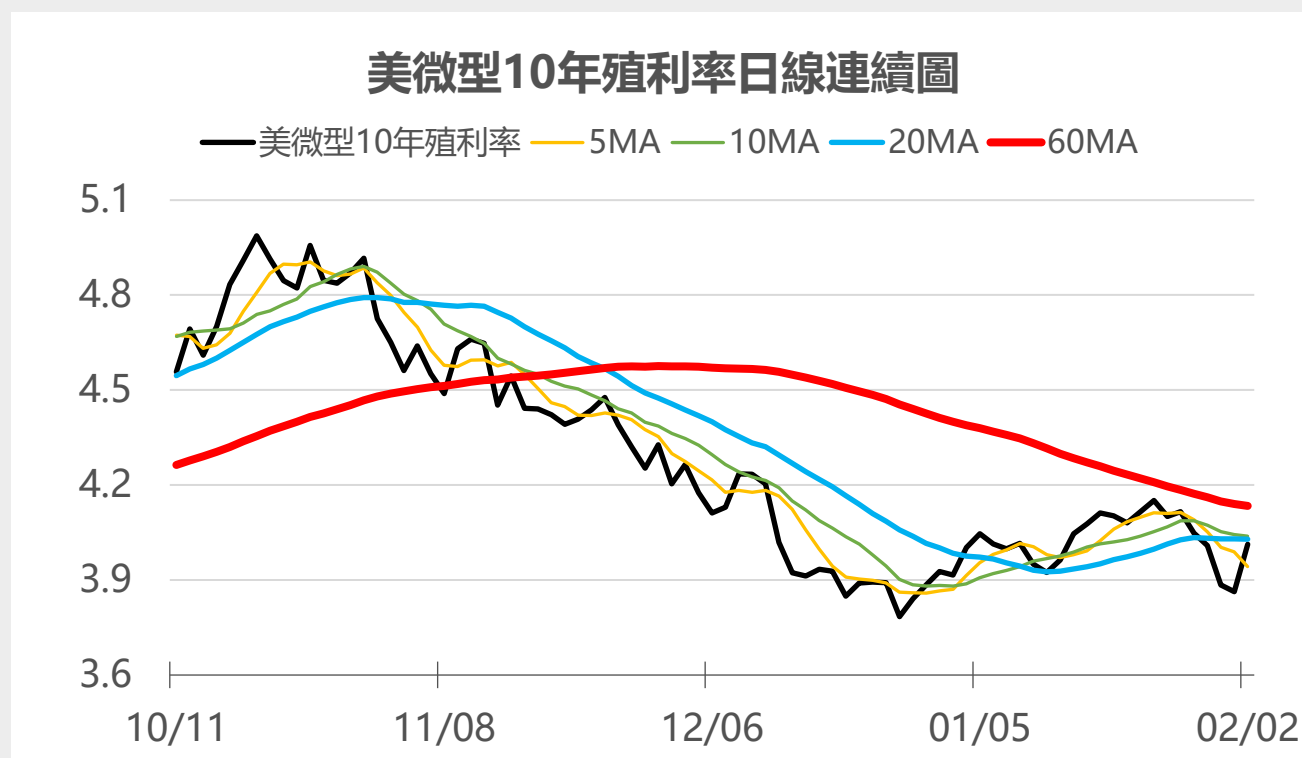
美國勞工部上週五(2日)公布今年元月就業報告，各項數據普遍強勁，非農就業人數激增35.3萬人，接近預估數的兩倍，去年12月增加人數也大幅上修，此外失業率維持在3.7%低檔，工資月升幅也比預估高出一倍，只有平均每人每周工時縮短。由於就業數據遠優於預估，這可能讓聯準會更堅信「不能急著降息」，使市場預期聯準會(Fed)3月降息機率更進一步下降。數據公布後，引發債市拋售潮，美國10年期公債殖利率創下近一年半來最大單日漲幅，上週五(2日)終場大漲16個基點至4.03%。



CBOT 交易所

微型10年殖利率(10Y)

原始保證金
USD 352
(新台幣約11,500)



美元、美債殖利率跳升 基本金屬延續疲態

美國勞工統計局上週五(2日)公布，1月非農就業人數增加35.3萬人，遠超預期的增加18.5萬人，失業率維持在3.7%，同時平均時薪月增0.6%也遠高於預期的月增0.3%，數據顯示美國經濟富有彈性，且工人生產力強勁，讓企業增聘和留用更多員工，市場進一步降低了3月份降息的可能性，甚至對5月份的降息產生懷疑，從而帶動美債殖利率和美元跳高。由於美國強勁的就業報告打擊降息預期並推升美元的影響，拖累上週五(2日)基本金屬延續疲態，3月交割的銅期貨終場下挫0.83%至每磅3.8215美元。

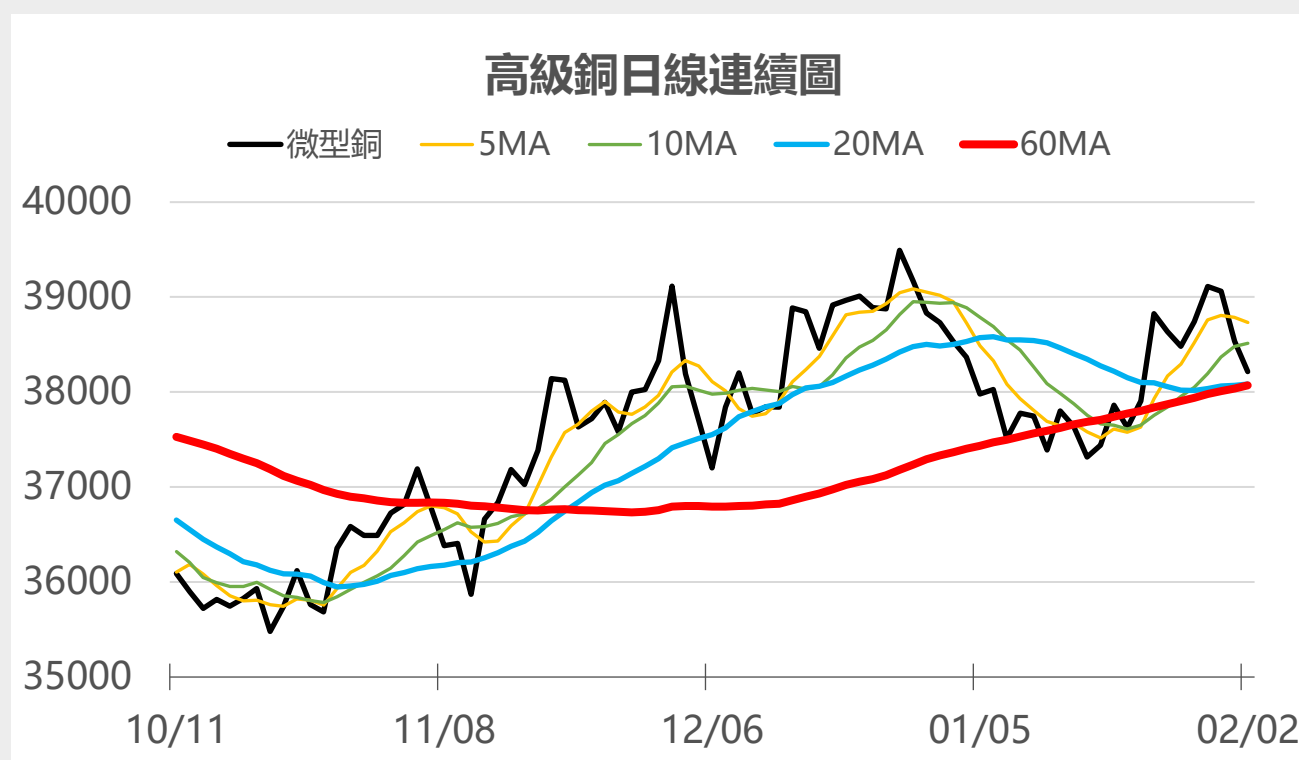
CMX交易所

微型銅(MHG)

原始保證金

USD 440

(新台幣約14,000)

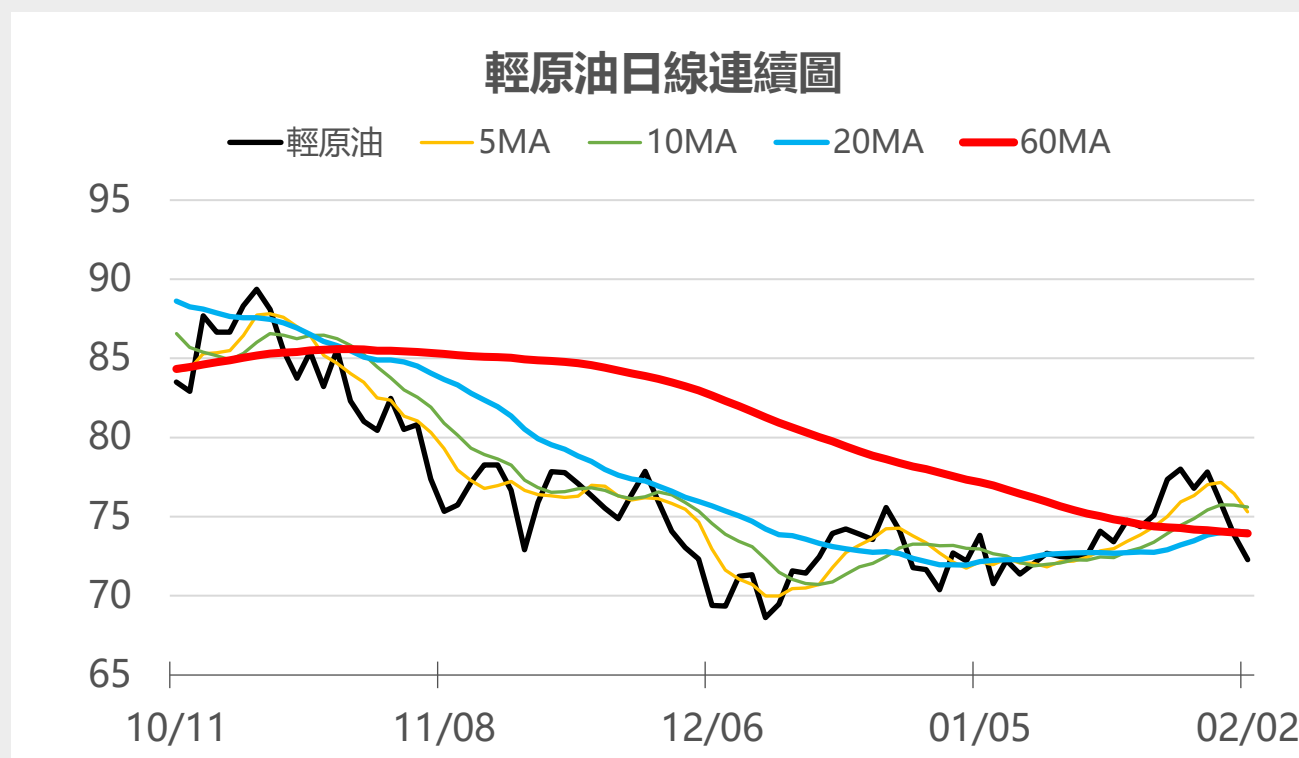


美軍展開大規模報復 襲擊敘利亞

美國總統拜登2/2表示，在他的指示下，美軍襲擊了伊朗伊斯蘭革命衛隊及其附屬民兵組織在伊拉克和敘利亞境內用來攻擊美軍的設施，美國中央司令部周五表示，空襲了伊拉克和敘利亞境內 85 個目標，目標是伊朗伊斯蘭革命衛隊聖城旅及其附屬民兵組織，以報復駐約旦美軍事基地遇襲。伊拉克武裝部隊總司令發言人表示，美軍的空襲侵犯了伊拉克主權，破壞了伊拉克政府的努力，將導致伊拉克和周邊地區陷入不可預見的後果，為伊拉克和地區的安全與穩定帶來災難性的打擊。



NYM 交易所
微型輕原油(MCL)
原始保證金
USD 726
(新台幣約23,000)

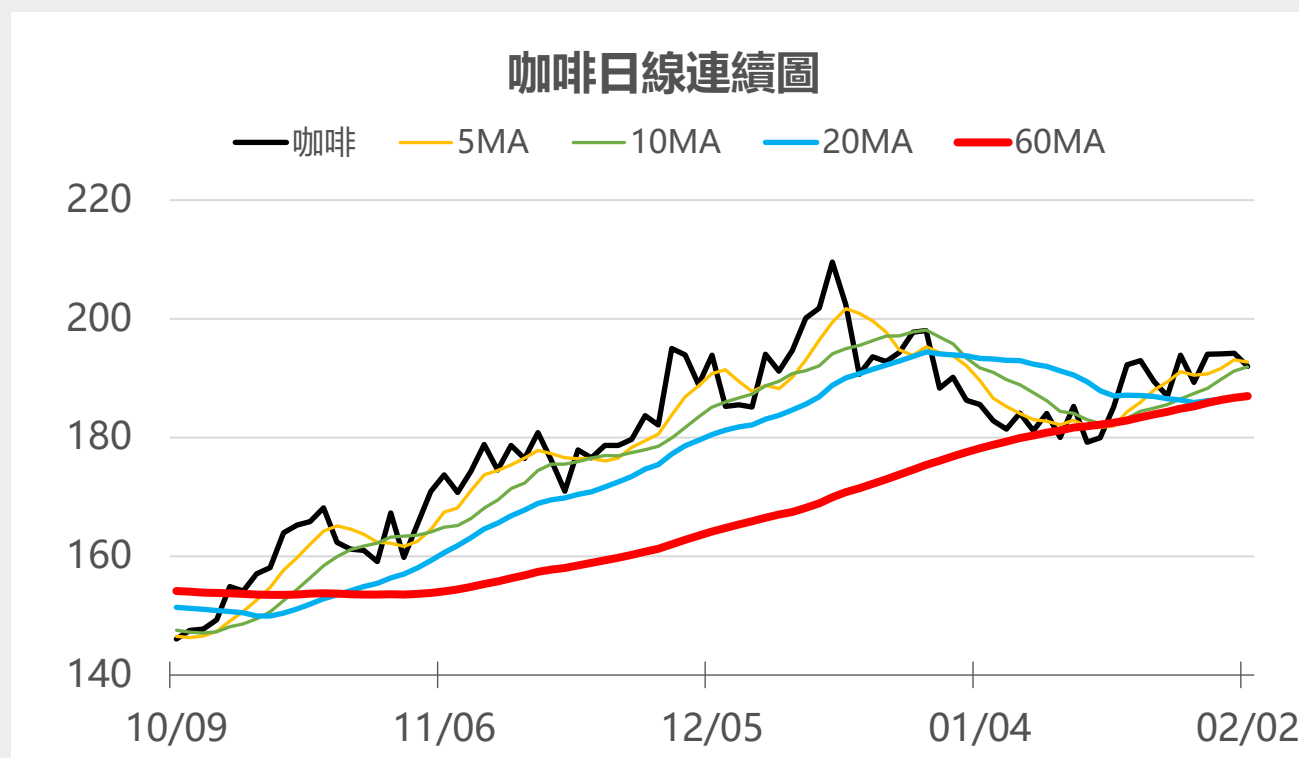


歐盟庫存咖啡豆來到近10年新低

根據歐洲咖啡聯合會資料顯示，歐盟12月庫存咖啡豆為728萬袋，創下自2013/12月以來新低水位。市場認為自從2023/6月底歐盟批准新法規，對於森林砍伐有更嚴格控管並且對於進口咖啡豆來源區域得附證明表示與環境破壞無關，自該法案頒布後歐盟庫存咖啡豆連續6個月下滑，自1156萬袋跌至728萬袋，當前庫存僅能滿足8~10週消費量。近期印尼、越南對於羅布斯塔咖啡豆的供應持續收緊，全球預估將短缺500萬袋，不過這缺口有望由巴西填補上。上週五(2日)3月咖啡期貨下跌1.1%至每磅1.9195美元。



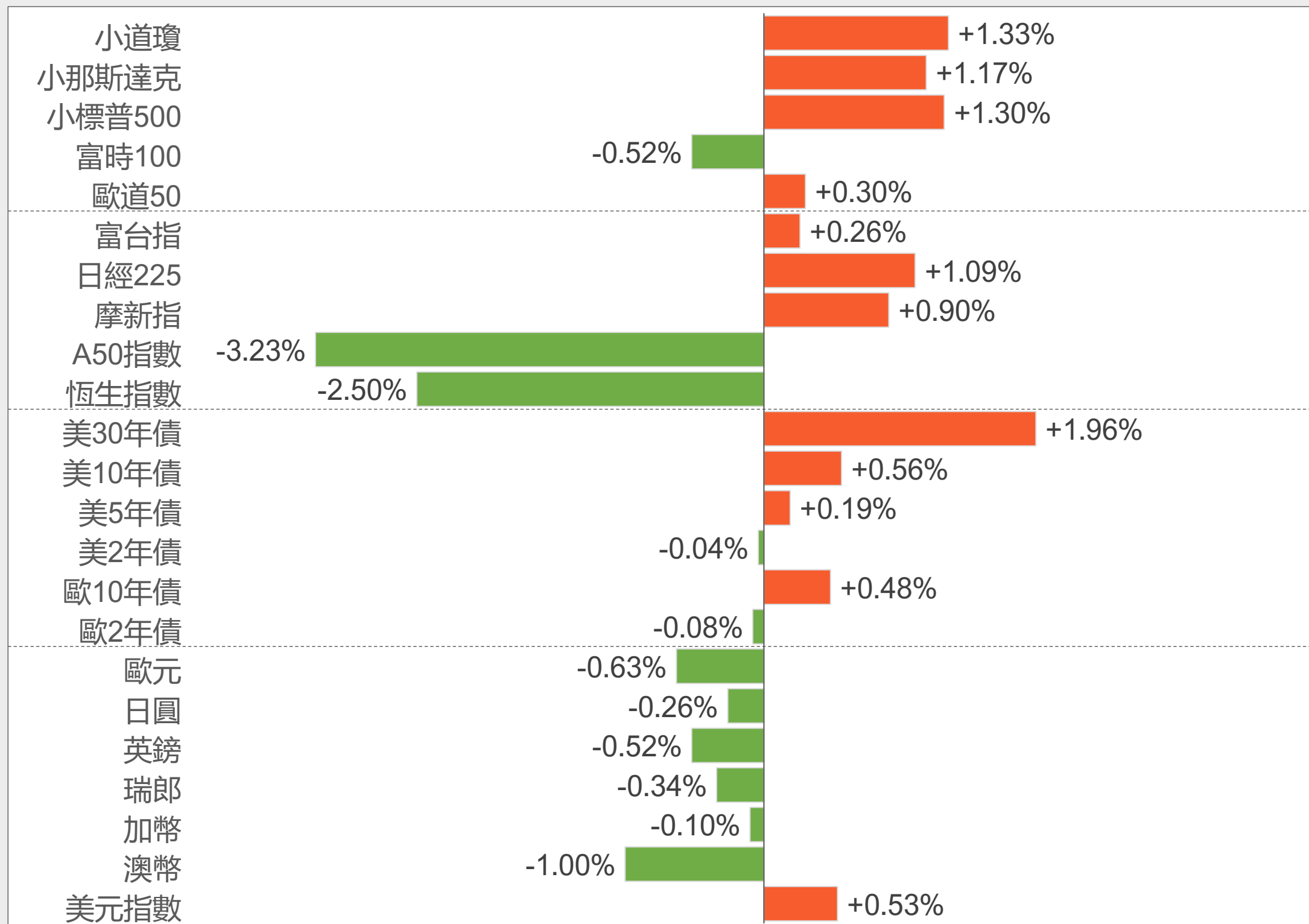
ICE-US 交易所
咖啡(KC)
原始保證金
USD 6,600
(新台幣約208,000)



聯準會升降息機率表% (CME FedWatch 2024/2/2 收盤數據整理)

利率區間	3.00 3.25	3.25 3.50	3.50 3.75	3.75 4.00	4.00 4.25	4.25 4.50	4.50 4.75	4.75 5.00	5.00 5.25	5.25 5.50
會議日期										
2024/03/20									20.5	79.5
2024/05/01								13.1	58.0	28.9
2024/06/12							12.3	55.2	30.7	1.8
2024/07/31						10.1	47.3	35.2	7.1	0.3
2024/09/18					9.7	45.8	35.7	8.2	0.6	
2024/11/07			0.2	10.4	45.6	35.1	8.1	0.6		
2024/12/18			4.8	25.8	41.0	23.3	4.8	0.3		
備註	1. 2022年3月至2023年7月累計升息11次共21碼 利率區間由0-0.25 ➔ 5.25-5.50 2. 其中2023年9月起已連續四次會議維持利率不變									目前利率

海期一週表現 **金 融 類** (2024/1/29~2/2)



海期一週表現 商品類 (2024/1/29~2/2)

