

冠力日参：对冲基金大幅度削减美股风险

报告日期：2024/7/23

市场简报

亚洲股市。上证指数下跌 0.61%，恒生指数上涨 1.25%，日经 225 下跌 1.16%。
欧洲股市主要上涨。英国 FTSE100 上涨 0.53%，德国 DAX 上涨 1.29%，法国 CAC40 上涨 1.16%。
美国股市主要下跌。标普 500 上涨 1.08%，道琼斯指数上涨 0.32%。
布伦特原油下跌 0.28%，黄金下跌 0.18%，比特币上涨 1.73%。

最新快讯

- 美國總統拜登正式宣佈退出競選連任，力挺副總統卡瑪拉·黛維·哈里斯 (Kamala Harris)(漢名賀錦麗)作為繼任人選 最終人選需等到 8 月 19 日至 22 日民主黨大會確認。
- 哈里斯贏得佩洛西支持，競選團隊稱在前 24 小時內籌集了 8,100 萬美元。
- 朝鮮向韓投放“垃圾气球”后一天，韩军全面启动对朝扩音喊话，内容包括朝鲜外交官弃朝投韩，以及朝军在韩朝非军事区北侧一带进行埋雷工作时因爆炸事故导致士兵死亡等消息。旨在严控信息传播的朝鲜传不为人知的信息，以动摇民心。
- 美股在经历了 4 月以来最糟糕的一周后实现反弹，投资者将目光从拜登退选转向科技公司财报季。标普 500 指数创下 6 月初以来的最大涨幅，纳斯达克 100 指数涨 1.5%，一项衡量“科技七巨头”的指标上涨约 2.5%
- “OPEC+原油出口减少应该有助于收紧市场供应，并在未来几周内将油价推高至每桶 90 美元，” Giovanni Staunovo 为首的分析师在报告中表示。
- 高盛集团主经纪商部门的一份报告显示，对冲基金大幅平掉多头和空头的风险仓位，速度为 2021 年 1 月以来的最快。美国 11 个板块中有 10 个出现风险平仓，信息技术、工业、金融、非必须消费品和医疗保健行业居首。



冠力资产管理有限公司，为香港证监会持牌注册法团，中央编码 BEL573，从事第 4 类就证券提供意见和第 9 类提供资产管理受规管活动。

香港办公室：香港灣仔駱克道
160-174 號越秀大廈 14 樓 1403 室

关注冠力金融微信公众号：



(852) 2768 3831

图表 1：全球重要市场指标

冠力国际			全球重要市场指标			2024年7月22日		
股票	昨收盘价	涨跌幅	商品	昨收盘价	涨跌幅			
道琼斯指数	40415.4	0.32%	彭博商品指数	98.0865	0.62%			
标普500	5564.4	1.08%	布伦特原油	82.4	-0.28%			
欧洲斯托克50	4897.4	1.45%	黄金	2396.59	-0.18%			
英国FTSE100	8198.78	0.53%	比特币	68147.88	1.73%			
德国DAX	18407.07	1.29%	汇率	昨收盘价	涨跌幅			
法国CAC40	7622.02	1.16%	美元指数	104.314	-0.08%			
日经225	39599.0	-1.16%	欧元美元	1.0891	0.08%			
恒生指数	17635.9	1.25%	美元人民币	7.2737	0.05%			
上证指数	2964.2	-0.61%	港币人民币	0.93164	0.09%			
深证成指	8869.82	-0.38%	利率/债券	昨收盘价	涨跌幅			
A50	12229.3	-1.08%	3m SHIBOR	1.894	-0.1bp			
MSCI世界指数	3584.7	0.87%	3m LIBOR	5.5446	0bp			
VIX	14.9	-1.6	美国10年利率	4.2525	1.36bp			

来源：冠力资产

图表 2：全球重要数据/事件

时间 (北京)	国家/地区	数据/事件
13:00	新加坡	新加坡核心消费者价格指数(CPI)年率
20:30	加拿大	加拿大新屋价格指数月率
22:00	美国	美国成屋销售年化总数(户) (六月)

来源：冠力资产

周一重要说明：本报告中提供的资讯和意见，由冠力资产管理有限公司向现在及潜在客户提供，并且以合理谨慎的原则编制，所用资料、资讯或资源均于出版时为真实和可靠的。报告中意见仅为在发表之日的即时意见。本报告所载的信息和意见如有变更，恕不另行通知。冠力资产管理有限公司没有义务更新这份研究报告。冠力资产管理有限公司对本报告或任何其内容的准确性或完整性或其他方面，无论明示或暗示，无作出任何陈述或保证。冠力资产管理有限公司，冠力金融服务有限公司，冠力国际金融集团有限公司，及其或其各自的董事，管理人员，合伙人，代表或雇员并不承担由于使用本报告的责任投资者应该审慎考虑本研究报告中详述的金融工具是否适合投资者的财务状况、投资目标和经验、风险承受能力和其他有关情况。本材料中任何内容不得(i)抄袭、复印或复制于任何形式、任何方式；或(ii)未经冠力资产管理有限公司书面同意转载与再发布。

披露：此研究报告由「冠力资产管理有限公司」的持牌人撰写，「冠力资产管理有限公司」为香港证监会持牌注册法团，从事第4类就证券提供意见和第9类提供资产管理受规管活动。本报告不构成任何签订协议的邀请或要约，所载全部资料仅供参考。本报告所表达的意见反映了「冠力资产管理有限公司」的意见。根据证券及期货事务监察委员会持牌或注册人士的操守守则，持牌人（及其关联人）确认未在下列情形下处置或交易本报告中所述金融产品 i) 与本研究报告相悖；ii) 自本报告之日三十日前或未来三交易日内。此外，所有持牌人（及其关联人）涉及本报告所述金融产品的情形已于表格1中披露。如所述金融产品为证券，持牌人（及其关联人）不存在与证券关联公司的雇佣关系。持牌人（及其关联人）不会因本报告所表达的具体建议或意见直接或间接的获取报酬。