

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2020年03月24日

市場回顧

美股下跌 聯準會實施無上限 QE 2兆抗疫振興法案卡關

美國股市

- 標普 500 指數下跌 2.93%，連 2 日下跌，累積跌幅 7.27%，儘管聯準會再度出招，推出無限量化寬鬆(QE)後，美股仍全面走低，主因受美國國會 2 兆美元抗疫振興計畫難產消息影響，三大指數進一步走跌。繼加州之後，川普將華盛頓州列入重大災區，目前已有包含紐約、加州和新澤西州等已有 10 州下令民眾待在家中，全美逾三分之一人受到影響。
- 為持續削減疫情所致的市場不確定性，美國聯準會昨日宣布，將無上限購入美國公債和抵押貸款證券，直到金額達到足以支持市場順利運作，有效壓低借貸成本為止。此外，也推出其他信貸工具包含 3000 億美元的商業貸款計畫，針對符合資格的中小企業提供貸款，以及定期資產擔保貸款便利，讓一些以學生、汽車、信用卡貸款或小型企業擔保貸款作為擔保品的證券能夠順利發行，為支持美國經濟的行動再添火力
- 美國先前提出的 2 兆美元大規模刺激方案，在上周日未能在參議院獲得通過，因民主黨表示，這項方案主要方向都在援助公司企業，卻沒有對一般勞工階級的保障，同時也缺乏監管。不過此次法案表決因有 5 名共和黨參議員處於自我檢疫或隔離狀態，削弱了共和黨的優勢，因此川普仍認為這項立法最終仍會獲得通過。
- 聯準會聖路易分行總裁周日表示，他預測為防範疫情所採取的各種限制行動，將使美國第 2 季失業率上升至 30%，GDP 將史無前例地下降 50%。同時他也呼籲政府應採取有力的財政措施因應，以彌補全季可能的 2.5 兆美元損失，並且相信在政府的積極回應下，經濟活動有望在第三季開始復甦。

歐股下跌 日股上漲 東京奧運即將延期

歐日股市

- 道瓊歐洲 600 指數下跌 4.30%。
- 東證指數上漲 0.68%，連 5 日上漲，累積漲幅 4.44%；日經指數上漲 2.02%，終止連 2 日下跌。在加拿大、澳洲相繼宣布退出參加 2020 年東京奧運後，原本抱持堅定立場的日本首相安倍晉三，也在態度上有所軟化，終於鬆口表示，賽事的延期或許會是不得已的選項之一，國際奧委會(IOC)資深委員在昨日也透漏，2020 東京奧運已確定延期舉辦，很可能推遲到 2021 年，但具體細節將在未來 4 週內決定。

新興市場、港、陸股下跌 亞太地區經濟成長率遭調降

新興市場
與
亞太股市

- MSCI 新興市場指數下跌 5.61%；新興亞洲下跌 5.55%；歐非中東下跌 4.76%，終止連 2 日上漲；拉丁美洲下跌 7.50%，終止連 2 日上漲。國際信評機構標普做出預測，新冠肺炎疫情將對亞太地區經濟體造成永久性收入損失總計達 6200 億美元，由先前預估的 2110 億美元大幅提升，並且預期包含新加坡、香港、南韓以及日本的 2020 年的經濟成長都將面臨收縮，而中國的成長率將放緩至 2.9%，亞太地區全年經濟成長率預估則為 2.7%。
- 恆生指數下跌 4.86%；國企指數下跌 4.02%。滬深 300 指數下跌 3.36%。
- 澳股下跌 5.62%。韓股下跌 5.34%。

美國公債價格上漲 美元指數下跌

債市
與匯市

- 美國 10 年期公債殖利率下跌 5.91 個基點，至 0.786%，公債價格上漲。
- 美元指數下跌 0.32%至 102.487；歐元升值 0.36%至 1.073；日圓貶值 0.27%至 111.23；澳幣升值 0.92%至 0.584；南非幣貶值 1.27%至 17.837。

原油、黃金價格上漲

油市
與貴金屬

- 原油價格上漲 3.23%至 23.36 元。
- 黃金價格上漲 3.64%至 1553.24 元。

| | 昨日收盤價 | 近1日(%) | 近5日(%) | 1個月(%) | 3個月(%) | 6個月(%) | 年初迄今(%) | 近1年(%) | 收盤日期 |
|-----------------|-----------|---------|---------|---------|---------|----------|----------|-----------|-----------|
| 成熟市場股市指數 | | | | | | | | | |
| 世界指數 | 1602.11 | -2.96 | -9.64 | -31.26 | -31.88 | -26.58 | -32.07 | -23.52 | 2020/3/23 |
| S&P 500 | 2237.40 | -2.93 | -6.23 | -30.64 | -30.59 | -24.58 | -30.75 | -20.11 | 2020/3/23 |
| 道瓊工業 | 18591.93 | -3.04 | -7.91 | -33.51 | -34.80 | -30.65 | -34.85 | -27.10 | 2020/3/23 |
| 那斯達克 | 6860.67 | -0.27 | -0.64 | -25.60 | -23.37 | -14.17 | -23.54 | -10.23 | 2020/3/23 |
| VIX指數 | 61.59 | -6.74 | -25.52 | 146.06 | 386.11 | 261.23 | 346.95 | 273.73 | 2020/3/23 |
| 加拿大TSX綜合 | 11228.49 | -5.26 | -9.16 | -36.07 | -34.64 | -33.16 | -34.20 | -30.21 | 2020/3/23 |
| 道瓊歐洲600 | 280.43 | -4.30 | -1.48 | -31.91 | -33.05 | -28.07 | -32.56 | -25.42 | 2020/3/23 |
| 英國富時 | 4993.89 | -3.79 | -3.05 | -30.22 | -34.57 | -31.51 | -33.79 | -30.71 | 2020/3/23 |
| 德國DAX | 8741.15 | -2.10 | -0.01 | -32.94 | -34.28 | -28.98 | -34.02 | -23.08 | 2020/3/23 |
| 法國巴黎 | 3914.31 | -3.32 | 0.85 | -32.42 | -35.08 | -30.45 | -34.52 | -25.72 | 2020/3/23 |
| 日經225 | 16887.78 | 2.02 | -3.12 | -27.79 | -29.13 | -23.58 | -28.61 | -21.91 | 2020/3/23 |
| 東證一部指數 | 1292.01 | 0.68 | 2.40 | -22.82 | -25.24 | -20.39 | -24.94 | -20.10 | 2020/3/23 |
| 澳洲 | 4546.04 | -5.62 | -12.13 | -33.34 | -31.54 | -31.08 | -30.41 | -24.92 | 2020/3/23 |
| 新興市場股市指數 | | | | | | | | | |
| 新興市場指數 | 758.20 | -5.61 | -8.28 | -28.15 | -31.64 | -25.03 | -31.98 | -28.45 | 2020/3/23 |
| 新興亞洲指數 | 413.24 | -5.55 | -7.61 | -23.78 | -26.58 | -18.97 | -27.00 | -23.48 | 2020/3/23 |
| 新興拉美指數 | 1,382.94 | -7.50 | -15.06 | -48.27 | -52.44 | -48.01 | -52.60 | -49.02 | 2020/3/23 |
| 歐非中東指數 | 158.71 | -4.76 | -7.03 | -35.27 | -40.55 | -36.46 | -40.68 | -37.28 | 2020/3/23 |
| 香港恆生 | 21,696.13 | -4.86 | -5.93 | -19.11 | -22.14 | -17.45 | -23.04 | -25.48 | 2020/3/23 |
| 香港國企 | 8,751.76 | -4.02 | -5.16 | -17.19 | -20.70 | -14.79 | -21.64 | -24.01 | 2020/3/23 |
| 滬深300指數 | 3,530.31 | -3.36 | -5.30 | -14.58 | -11.59 | -9.50 | -13.82 | -7.92 | 2020/3/23 |
| 台灣加權 | 8,890.03 | -3.73 | -8.52 | -22.93 | -25.77 | -18.57 | -25.90 | -16.44 | 2020/3/23 |
| 韓國KOSPI | 1,482.46 | -5.34 | -11.36 | -28.69 | -32.31 | -29.44 | -32.54 | -32.21 | 2020/3/23 |
| 印度SENSEX | 25,981.24 | -13.15 | -17.23 | -35.63 | -37.34 | -33.55 | -37.02 | -31.92 | 2020/3/23 |
| 馬來西亞 | 1,259.88 | -3.33 | -1.62 | -15.45 | -21.47 | -20.88 | -20.70 | -24.41 | 2020/3/23 |
| 泰國SET | 1,024.46 | -9.12 | -2.07 | -28.64 | -34.69 | -37.17 | -35.15 | -37.77 | 2020/3/23 |
| 印尼雅加達綜合 | 3,989.52 | -4.90 | -14.95 | -31.30 | -36.73 | -35.00 | -36.67 | -38.86 | 2020/3/23 |
| 菲律賓綜合股價 | 4,743.37 | -0.74 | -17.31 | -34.00 | -39.75 | -39.91 | -39.31 | -40.81 | 2020/3/23 |
| 俄羅斯RTS | 883.78 | -4.38 | -8.60 | -42.04 | -42.63 | -34.96 | -42.94 | -27.16 | 2020/3/23 |
| 南非40指數 | 34,695.90 | -4.43 | -4.42 | -29.60 | -32.00 | -29.99 | -31.72 | -30.32 | 2020/3/23 |
| 巴西聖保羅 | 63,569.62 | -5.22 | -10.68 | -44.08 | -45.13 | -38.80 | -45.03 | -32.18 | 2020/3/23 |
| 墨西哥Bolsa | 32,964.22 | -3.81 | -13.45 | -24.77 | -25.35 | -23.52 | -24.29 | -22.06 | 2020/3/23 |
| 匯市與油金 | | | | | | | | | |
| 美元指數 | 102.487 | -0.32 | 4.50 | 3.25 | 4.94 | 3.94 | 6.33 | 6.04 | 2020/3/23 |
| 歐元兌美元 | 1.073 | 0.36 | -2.12 | -0.83 | -2.93 | -2.32 | -4.00 | -4.84 | 2020/3/23 |
| 美元兌日圓 | 111.230 | -0.27 | -2.83 | -0.11 | -1.31 | -3.40 | -2.01 | -0.78 | 2020/3/23 |
| 澳幣兌美元 | 0.584 | 0.92 | -2.07 | -11.04 | -15.11 | -13.60 | -16.31 | -17.38 | 2020/3/23 |
| 美元兌境外人民幣 | 7.121 | 0.02 | -1.11 | -1.05 | -1.49 | -0.06 | -2.09 | -5.53 | 2020/3/23 |
| 美元兌台幣 | 30.347 | -0.36 | -0.50 | 0.38 | -0.58 | 2.20 | -1.17 | 1.57 | 2020/3/23 |
| 美元兌巴西里爾 | 5.142 | -1.53 | -2.73 | -14.65 | -20.66 | -18.98 | -21.72 | -25.03 | 2020/3/23 |
| 美元兌南非蘭德 | 17.837 | -1.27 | -6.48 | -14.75 | -20.33 | -16.34 | -21.22 | -19.49 | 2020/3/23 |
| 西德州原油 | 23.360 | 3.23 | -10.54 | -52.60 | -59.43 | -55.29 | -59.23 | -58.38 | 2020/3/23 |
| 黃金現貨 | 1,553.24 | 3.64 | 2.57 | -5.53 | 4.55 | 2.33 | 3.32 | 19.33 | 2020/3/23 |
| 債市 | | | | | | | | | |
| 公債指數 | 收盤價(%) | 近1日(bp) | 近5日(bp) | 1個月(bp) | 3個月(bp) | 6個月(bp) | 年初迄今(bp) | 近1年(bp) | 收盤日期 |
| 美國2年期公債 | 0.312 | -0.110 | -4.76 | -104.20 | -134.00 | -136.89 | -125.68 | -200.43 | 2020/3/23 |
| 美國10年期公債 | 0.786 | -5.910 | 6.81 | -68.50 | -114.31 | -94.04 | -113.12 | -165.27 | 2020/3/23 |
| 美國30年期公債 | 1.351 | -6.600 | 6.68 | -56.38 | -100.58 | -82.20 | -103.87 | -152.30 | 2020/3/23 |
| 德國2年期公債 | -0.685 | -0.800 | 20.00 | -4.70 | -6.70 | 5.70 | -8.40 | -12.00 | 2020/3/23 |
| 德國10年期公債 | -0.375 | -5.400 | 8.60 | 5.60 | -13.30 | 20.60 | -19.00 | -36.00 | 2020/3/23 |
| 美銀美林債券指數 | 近1日(%) | 本月迄今(%) | 本季迄今(%) | 年初迄今(%) | 近1年(%) | 近3年年化(%) | 近5年年化(%) | 近10年年化(%) | 收盤日期 |
| 美國公債 | 1.437 | 2.889 | 8.41 | 8.41 | 13.94 | 5.99 | 3.71 | 3.87 | 2020/3/23 |
| 美國MBS | 0.987 | -0.030 | 1.71 | 1.71 | 6.14 | 3.77 | 2.76 | 3.13 | 2020/3/23 |
| 美國投資級公司債 | 0.449 | -13.176 | -9.97 | -9.97 | -1.60 | 1.89 | 1.96 | 4.17 | 2020/3/23 |
| 新興市場本地債 | -0.313 | -4.970 | -3.43 | -3.43 | 4.40 | 3.50 | 2.78 | 3.03 | 2020/3/23 |
| 新興市場美元債 | -1.733 | -18.934 | -18.55 | -18.55 | -11.58 | -1.46 | 1.77 | 4.21 | 2020/3/23 |
| 美國高收益債 | -2.256 | -19.313 | -20.56 | -20.56 | -15.02 | -2.04 | 0.92 | 4.60 | 2020/3/23 |
| 歐洲高收益債 | -1.138 | -17.529 | -18.57 | -18.57 | -11.56 | -0.33 | 1.91 | 5.89 | 2020/3/23 |

富盛證券投資顧問股份有限公司 (102)金管投顧新字 019 號。臺北總公司：臺北市信義區松德路 171 號 9 樓；(02)2728-3222。台中分公司：台中市市政北一路 77 號 14 樓之 11；(04)2251-3477。台南分公司：台南市林森路 1 段 395 號 9 樓之 6；(06)236-5208。本報告所載係根據各項市場資訊加以整理匯集及研究分析，僅供參考，本公司不保證其正確性及完整性。內容如涉及有價證券或金融商品相關記載或說明，並不構成要約、招攬、宣傳、建議推薦買賣等任何形式之表示，投資人如參考本報告進行相關投資或交易，應自行承擔所有損益，本公司不負任何法律責任。非經本公司同意，不得將本報告內容之一部或全部加以複製、轉載或散佈。本文所提及之個股，僅供舉例之用，不代表本基金之必然持股，亦不代表任何金融商品之推介或建議。富盛證券投顧為先機環球系列基金台灣總代理【富盛證券投顧獨立經營管理】