

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2020年05月05日

市場回顧

美股上漲 聯準會開始進行次級市場購債計畫

美國股市

- 標普 500 指數上漲 0.42%，終止連 2 日下跌。在上週巴菲特透露已清倉航空股後，昨日開盤後航空類股狂瀉，美股早盤跌幅加劇，所幸尾盤時段，油價跌幅收斂，能源股應聲走高，科技類股也逆勢上漲，帶動四大指數上演逆轉行情。
- 紐約聯邦儲備銀行昨日宣布，聯準會將自 5 月初起開始購買符合資格的債券指數基金(ETF)，包括投資級公司債與近期成為「墮落天使」的高收益債券資產，為債市挹注流動性，根據 3 月時公布將分配至次級市場企業融資機制(SMCCF)的金額高達 250 億美元，並將實施至今年 9 月底。

歐股下跌 日股休市 歐元區第一季 GDP 負成長、PMI 暴跌

歐日股市

- 道瓊歐洲 600 指數下跌 2.65%，連 3 日下跌，累積跌幅 5.46%。歐元區公佈第一季 GDP 增長率為-3.8%，較前值 0.1%大幅衰退，由於各國政府採取的社交距離及封鎖措施，導致商業活動停滯，多數企業面臨閉門風險，且失業人口亦大幅攀升。陷入嚴重經濟衰退的歐洲各國也正考慮發行「新冠債券」(Corona Bonds)，以疏緩各國的財政壓力，但德國及荷蘭政府卻擔憂該債券可能導致的債務風險，因此仍抱持反對意見。
- 歐元區公佈 4 月份製造業 PMI 終值由 3 月的 44.5 暴跌至 33.4，創下該指數開始統計以來的最低值，企業停工的影響更造成生產分項指數暴跌至 18.1。IHS Markit 表示，歐元區企業及就業市場正面臨嚴重的威脅，且距離企業恢復至正常營運、以及消費需求的回溫，仍需要一段較長的時間。
- 日股休市。

新興市場、港股下跌 陸股休市 中國製造業 PMI 下滑

新興市場
與
亞太股市

- MSCI 新興市場指數下跌 3.14%，連 2 日下跌，累積跌幅 4.02%；新興亞洲下跌 3.30%，連 2 日下跌，累積跌幅 4.00%；歐非中東下跌 2.62%；拉丁美洲下跌 2.36%，連 3 日下跌，累積跌幅 6.52%。
- 恆生指數下跌 4.18%，終止連 3 日上漲；國企指數下跌 4.40%，終止連 3 日上漲。陸股休市。財新公佈 4 月份中國製造業 PMI 為 49.4，由 3 月份 50.1 下滑，重回衰退區間，顯示製造業景氣不佳。而財新公布之數據較中國統計局更為悲觀，中國統計局所公布之製造業 PMI 為 50.8，僅較 3 月份下滑 1.2，持穩於榮枯線之上。財新指出隨著中國的復工與復產，製造業生產雖連續兩個月出現回升，但整體成長力道仍屬疲軟。新訂單指數則連續三個月處於衰退區間，主因海外需求減弱，出口訂單減少幅度太大，嚴重限制中國經濟的反彈幅度。
- 澳股上漲 1.41%。韓股下跌 2.68%，終止連 3 日上漲。IHS Markit 公布南韓 4 月份製造業 PMI 為 41.6，由 3 月份 44.2 進一步下滑，因全球性的停工措施使得南韓製造業受到重創，出口訂單指數嚴重下滑至 16 年來新低。南韓貿易部上週五公布 4 月份出口額年減 24.3%，為 2009 年金融危機以來最大降幅，且導致南韓出現 2012 年以來首見的貿易逆差。經濟仰賴進口的南韓是全球最早公布此數據的國家，這項數據反映新冠肺炎疫情下各國經濟封鎖，全球貿易前景烏雲罩頂。

美國公債價格下跌 美元指數上漲

債市
與匯市

- 美國 10 年期公債殖利率上漲 2.18 個基點，至 0.634%，公債價格下跌。
- 美元指數上漲 0.41%至 99.484；歐元貶值 0.67%至 1.091；日圓升值 0.16%至 106.74；澳幣升值 0.16%至 0.643；南非幣升值 1.20%至 18.588。

原油、黃金價格上漲

油市
與貴金屬

- 原油價格上漲 3.08%至 20.39 元。
- 黃金價格上漲 0.10%至 1702.07 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	1997.75	-0.35	-1.27	12.43	-16.93	-11.58	-15.29	-8.27	2020/5/4
S&P 500	2842.74	0.42	-1.24	14.23	-14.75	-7.54	-12.01	-3.49	2020/5/4
道瓊工業	23749.76	0.11	-1.59	12.81	-18.92	-13.61	-16.78	-10.40	2020/5/4
那斯達克	8710.72	1.23	-0.22	18.14	-8.39	3.27	-2.92	6.70	2020/5/4
VIX指數	35.97	-3.28	8.05	-23.14	137.43	174.58	161.03	179.49	2020/5/4
加拿大TSX綜合	14745.04	0.85	0.70	13.96	-16.47	-11.61	-13.59	-10.61	2020/5/4
道瓊歐洲600	328.44	-2.65	-2.09	6.27	-22.47	-18.75	-21.02	-15.86	2020/5/4
英國富時	5753.78	-0.16	-1.59	6.25	-23.10	-22.12	-23.71	-22.04	2020/5/4
德國DAX	10466.80	-3.64	1.26	9.88	-22.34	-20.40	-21.00	-15.68	2020/5/4
法國巴黎	4378.23	-4.24	-0.34	5.38	-26.85	-25.12	-26.76	-21.10	2020/5/4
日經225	19619.35	-2.84	0.98	10.10	-15.01	-14.14	-17.07	-11.86	2020/5/1
東證一部指數	1431.26	-2.24	0.37	8.01	-15.02	-14.12	-16.85	-11.54	2020/5/1
澳洲	5319.85	1.41	-0.03	4.98	-23.74	-20.57	-20.41	-16.04	2020/5/4
新興市場股市指數									
新興市場指數	887.98	-3.14	-1.63	6.76	-18.49	-17.11	-20.34	-17.99	2020/5/4
新興亞洲指數	484.64	-3.30	-1.71	6.94	-12.65	-10.81	-14.39	-11.94	2020/5/4
新興拉美指數	1,600.58	-2.36	2.91	7.93	-43.41	-43.21	-45.14	-41.48	2020/5/4
歐非中東指數	185.65	-2.61	-1.33	5.03	-28.48	-27.83	-30.61	-30.01	2020/5/4
香港恆生	23,613.80	-4.18	-1.52	1.63	-11.85	-14.70	-16.23	-21.50	2020/5/4
香港國企	9,599.02	-4.40	-1.08	1.14	-8.53	-11.75	-14.05	-17.07	2020/5/4
滬深300指數	3,912.58	1.18	2.16	6.46	-2.28	-1.01	-4.49	-0.02	2020/4/30
台灣加權	10,720.48	-2.47	3.61	10.94	-7.37	-7.93	-10.64	-3.39	2020/5/4
韓國KOSPI	1,895.37	-2.68	-1.01	9.85	-12.48	-11.54	-13.76	-13.70	2020/5/4
印度SENSEX	31,715.35	-5.94	1.24	14.95	-22.91	-21.20	-23.12	-18.60	2020/5/4
馬來西亞	1,376.59	-2.22	0.49	3.45	-10.42	-14.32	-13.35	-15.92	2020/5/4
泰國SET	1,301.66	1.48	2.29	17.74	-14.03	-18.26	-17.61	-22.22	2020/4/30
印尼雅加達綜合	4,605.49	-2.35	2.43	-0.39	-22.97	-26.48	-26.89	-27.12	2020/5/4
菲律賓綜合股價	5,572.09	-2.26	1.96	4.21	-24.22	-32.19	-28.70	-30.07	2020/5/4
俄羅斯RTS	1,099.42	-2.28	1.67	4.72	-29.55	-24.72	-29.02	-11.93	2020/5/4
南非40指數	45,254.03	-2.36	-0.89	10.72	-12.10	-11.24	-10.95	-14.66	2020/5/4
巴西聖保羅	78,876.22	-2.02	4.71	13.43	-32.02	-27.45	-31.79	-17.84	2020/5/4
墨西哥Bolsa	36,370.43	-0.27	5.16	9.96	-18.78	-16.60	-16.47	-17.86	2020/5/4
匯市與油金									
美元指數	99.484	0.41	-0.56	-1.09	1.55	2.03	3.21	2.01	2020/5/4
歐元兌美元	1.091	-0.67	0.78	1.03	-0.86	-1.54	-2.76	-2.63	2020/5/4
美元兌日圓	106.740	0.16	0.18	2.38	2.95	2.32	1.81	3.82	2020/5/4
澳幣兌美元	0.643	0.16	-1.02	5.54	-4.76	-6.79	-8.49	-8.10	2020/5/4
美元兌境外人民幣	7.131	0.06	-0.60	-0.34	-2.18	-1.80	-2.37	-5.01	2020/5/4
美元兌台幣	29.831	-0.32	0.65	1.27	1.22	1.96	0.54	3.65	2020/5/4
美元兌巴西里爾	5.544	-1.04	1.96	-4.72	-23.26	-27.53	-27.40	-28.43	2020/5/4
美元兌南非蘭德	18.588	1.20	0.95	0.94	-20.08	-20.22	-24.28	-21.76	2020/5/4
西德州原油	20.390	3.08	74.72	-30.23	-57.98	-61.22	-63.73	-63.70	2020/5/4
黃金現貨	1,702.07	0.10	-0.26	5.09	9.47	14.81	12.26	33.16	2020/5/4
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	0.182	-0.780	-4.01	-4.67	-122.68	-140.00	-138.69	-215.08	2020/5/4
美國10年期公債	0.634	2.180	-2.69	3.88	-96.55	-114.34	-128.39	-189.14	2020/5/4
美國30年期公債	1.277	2.790	2.08	6.71	-80.04	-98.65	-111.31	-164.21	2020/5/4
德國2年期公債	-0.752	0.800	-9.10	-9.00	-9.80	-10.30	-15.10	-16.50	2020/5/4
德國10年期公債	-0.563	2.300	-11.00	-12.20	-16.40	-21.20	-37.80	-58.80	2020/5/4
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	-0.002	-0.087	0.32	9.15	14.76	6.06	4.09	3.86	2020/5/4
美國MBS	0.029	0.006	0.78	3.59	7.90	4.19	3.16	3.31	2020/5/4
美國投資級公司債	-0.150	-0.331	4.92	0.67	9.07	5.41	4.49	5.18	2020/5/4
新興市場本地債	0.017	0.020	2.76	1.43	9.81	5.06	3.88	3.46	2020/5/4
新興市場美元債	-0.080	-0.137	2.71	-11.68	-4.86	0.61	2.87	4.97	2020/5/4
美國高收益債	-0.155	-0.433	3.35	-10.21	-5.67	1.32	3.08	5.62	2020/5/4
歐洲高收益債	-0.695	-0.682	5.35	-9.50	-3.57	2.58	3.89	6.76	2020/5/4

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】