

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2020年05月13日

市場回顧

美國股市

美股下跌 美國暫停政府退休基金投資中國股市

- 標普 500 指數下跌 2.05%，終止連 3 日上漲，因科技股的樂觀情緒消退，且市場擔心一些州過早解除限制可能引發第二波傳染，並對經濟造成進一步損害。聯準會紐約分行表示，聯準會將開始進入公司債市場，將會針對相關追蹤公司債的 ETF 進行購買，購買計畫以美國投資級公司債券為優先購買，其次才是美國高收益公司債券，並會針對 ETF 成分股、管理方式以及 ETF 持有的債務數量來做購買審核依據。
- 報導指出，川普政府下令美國相關政府基金禁止投資中國股市。國家經濟顧問庫德洛與國家安全顧問歐布萊恩與多位共和黨和民主黨國會議員前後致信勞工部長表示，他們質疑退休基金投資中國股市的合適性，並強調投資風險和國家安全的疑慮，最終聯邦退休儲蓄投資委員會決定，將暫停所有政府退休基金對中國股市的投資。
- 美國 4 月份的核心 CPI 指數月增率為 -0.4%，跌幅較 3 月份的 -0.1% 擴大，且創下自 1957 年以來最大跌幅。

歐日股市

歐股上漲 英國延長就業保留計畫 日股下跌

- 道瓊歐洲 600 指數上漲 0.26%。為了盡可能保護更多工作崗位，英國財政大臣蘇南克宣布將就業保留計畫延長至 10 月底，但鑒於政府財政壓力加劇，企業必須自 8 月起與政府共同分擔兼職員工薪資。蘇南克表示，政府的計畫在 7 月底前皆維持不變，自 8 月起將陸續採取更多靈活措施，更多修改細節將在 5 月底前公布，預計這有助於新增 750 萬個工作崗位，並使近百萬名雇主受惠。
- 東證指數下跌 0.26%，終止連 2 日上漲；日經指數下跌 0.12%，終止連 3 日上漲。日本政府公布 4 月中上旬的貿易統計初值。出口額報 3 兆 3730 億日圓(年減 22.4%)，下滑幅度較前月同期的年減 5.9%，降幅擴大原因為汽車、汽車零組件，以及引擎等發動機的出口減少。進口額報 4 兆 1249 億日圓(年減 14.6%)。出現 7519 億日圓的貿易逆差，也是連續第 2 個月在中上旬出現貿易赤字。

新興市場 與 亞太股市

新興市場、港股下跌 陸股持平 中國 CPI 及 PPI 均遜於預期

- MSCI 新興市場指數下跌 0.72%，終止連 2 日上漲；新興亞洲下跌 0.97%，終止連 2 日上漲；歐非中東上漲 1.15%；拉丁美洲下跌 1.24%，連 2 日下跌，累積跌幅 2.91%。
- 恆生指數下跌 1.45%，終止連 2 日上漲；國企指數下跌 1.59%，終止連 2 日上漲；滬深 300 指數持平，因市場擔憂新冠疫情第二波來襲，且中國 4 月工業生產者出廠價格指數(PPI)大幅下滑凸顯疫情給經濟帶來的影響。中國統計局公布 4 月 CPI 年增 3.3%，低於預期 3.7% 和前期 4.3%，為 2019 年 9 月以來最低。4 月 PPI 年減 3.1%，遜於預期的減少 2.5%，為四年來最大跌幅。中國國務院關稅稅則委員會公告，第二批對美加徵關稅商品排除清單，主要包括稀土金屬礦、黃金礦砂等 79 項商品。公告內容指出，自 2020 年 5 月 19 日至 2021 年 5 月 18 日，不再加徵中國為反制美 301 措施所加徵的關稅。
- 澳股下跌 1.07%，終止連 2 日上漲。韓股下跌 0.68%，連 2 日下跌，累積跌幅 1.22%。南韓 3 月份入境旅客的收入為 7.298 億美元，比去年同期下降 67%，是自 2011 年 1 月以來的最低。

債市 與匯市

美國公債價格上漲 美元指數下跌

- 美國 10 年期公債殖利率下跌 4.48 個基點，至 0.665%，公債價格上漲。
- 美元指數下跌 0.30% 至 99.933；歐元升值 0.38% 至 1.085；日圓升值 0.49% 至 107.140；澳幣貶值 0.28% 至 0.647；南非幣貶值 0.04% 至 18.431。

油市 與貴金屬

原油、黃金價格上漲

- 原油價格上漲 6.79% 至 25.78 元。
- 黃金價格上漲 0.28% 至 1702.70 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	2034.06	-1.29	1.32	3.95	-16.29	-10.33	-13.76	-2.51	2020/5/12
S&P 500	2870.12	-2.05	0.06	3.93	-14.93	-7.24	-11.16	2.07	2020/5/12
道瓊工業	23764.78	-1.89	-0.50	1.60	-19.23	-14.46	-16.73	-6.16	2020/5/12
那斯達克	9002.55	-2.06	2.20	9.89	-7.30	6.14	0.33	17.73	2020/5/12
VIX指數	33.04	19.84	-1.70	-19.75	133.50	154.15	139.77	60.78	2020/5/12
加拿大TSX綜合	14881.16	-1.47	0.47	5.72	-16.50	-12.25	-12.79	-8.10	2020/5/12
道瓊歐洲600	340.57	0.26	1.51	2.64	-21.00	-16.09	-18.10	-8.59	2020/5/12
英國富時	5994.77	0.93	4.19	2.60	-19.56	-18.45	-20.52	-16.32	2020/5/12
德國DAX	10819.50	-0.05	0.84	2.41	-21.29	-18.22	-18.34	-8.90	2020/5/12
法國巴黎	4472.50	-0.39	-0.24	-0.76	-26.60	-24.29	-25.18	-15.01	2020/5/12
日經225	20366.48	-0.12	0.86	6.95	-14.53	-12.66	-13.91	-3.89	2020/5/12
東證一部指數	1476.72	-0.26	0.87	5.04	-13.80	-13.15	-14.21	-4.18	2020/5/12
澳洲	5403.05	-1.07	-0.07	0.29	-23.94	-19.34	-19.17	-14.20	2020/5/12

新興市場股市指數									
新興市場指數	909.31	-0.72	1.18	2.96	-17.79	-12.89	-18.42	-10.54	2020/5/12
新興亞洲指數	497.65	-0.97	1.19	4.22	-12.53	-6.26	-12.09	-3.41	2020/5/12
新興拉美指數	1,577.19	-1.24	-3.22	-5.52	-43.54	-40.57	-45.94	-39.01	2020/5/12
歐非中東指數	191.24	1.15	2.64	0.84	-25.27	-24.73	-28.53	-23.88	2020/5/12
香港恆生	24,245.68	-1.45	1.58	-0.22	-12.57	-8.75	-13.99	-15.08	2020/5/12
香港國企	9,832.10	-1.59	1.38	0.21	-9.26	-6.53	-11.96	-10.05	2020/5/12
滬深300指數	3,960.24	0.00	1.22	5.51	0.01	1.55	-3.33	7.95	2020/5/12
台灣加權	10,879.47	-1.21	0.97	7.73	-7.74	-5.13	-9.32	3.04	2020/5/12
韓國KOSPI	1,922.17	-0.68	-0.34	5.28	-13.92	-9.44	-12.54	-7.54	2020/5/12
印度SENSEX	31,371.12	-0.60	-0.26	2.22	-24.33	-21.80	-23.96	-15.42	2020/5/12
馬來西亞	1,379.93	-0.17	-1.98	1.76	-10.35	-13.60	-13.14	-13.81	2020/5/12
泰國SET	1,299.69	0.96	-0.15	5.09	-15.21	-19.53	-17.73	-20.76	2020/5/12
印尼雅加達綜合	4,588.73	-1.09	-0.36	-0.76	-21.85	-25.30	-27.16	-25.21	2020/5/12
菲律賓綜合股價	5,651.67	-0.29	-0.35	0.73	-23.66	-28.89	-27.68	-27.00	2020/5/12
俄羅斯RTS	1,137.28	0.08	3.44	1.09	-26.32	-20.90	-26.58	-5.82	2020/5/12
南非40指數	46,518.03	0.34	2.89	6.11	-10.64	-7.18	-8.46	-7.30	2020/5/12
巴西聖保羅	77,871.95	-1.51	-2.01	-1.22	-32.67	-26.58	-32.66	-15.10	2020/5/12
墨西哥Bolsa	37,462.89	-0.45	2.31	8.23	-16.76	-13.08	-13.96	-13.16	2020/5/12

匯市與油金									
美元指數	99.933	-0.30	0.22	0.42	0.89	1.65	3.68	2.67	2020/5/12
歐元兌美元	1.085	0.38	0.51	-0.59	0.08	-1.43	-3.24	-3.31	2020/5/12
美元兌日圓	107.140	0.49	-0.98	0.56	2.47	1.54	1.34	1.99	2020/5/12
澳幣兌美元	0.647	-0.28	1.05	1.33	-3.75	-5.43	-7.89	-6.87	2020/5/12
美元兌境外人民幣	7.107	-0.02	0.30	-0.76	-1.68	-1.10	-2.06	-2.76	2020/5/12
美元兌台幣	29.893	-0.20	-0.18	0.67	0.39	1.76	0.33	3.95	2020/5/12
美元兌巴西里爾	5.886	-1.13	-5.22	-11.67	-26.04	-29.26	-31.62	-32.15	2020/5/12
美元兌南非蘭德	18.431	-0.04	1.95	-1.59	-18.82	-19.06	-24.01	-22.21	2020/5/12
西德州原油	25.780	6.79	5.21	-13.74	-51.60	-54.71	-57.54	-57.11	2020/5/12
黃金現貨	1,702.70	0.28	1.05	-0.69	8.09	16.39	12.27	31.04	2020/5/12

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	0.159	-1.580	-2.93	-6.65	-128.48	-150.34	-141.02	-210.72	2020/5/12
美國10年期公債	0.665	-4.480	0.32	-5.40	-96.82	-126.96	-125.24	-180.21	2020/5/12
美國30年期公債	1.370	-4.620	3.78	2.63	-71.92	-104.64	-101.98	-151.69	2020/5/12
德國2年期公債	-0.721	2.800	7.00	-10.10	-8.60	-9.80	-12.00	-10.60	2020/5/12
德國10年期公債	-0.505	0.700	7.30	-15.80	-12.70	-25.30	-32.00	-46.00	2020/5/12

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	0.359	-0.379	0.02	8.83	13.86	5.91	4.15	3.80	2020/5/12
美國MBS	-0.041	-0.177	0.60	3.40	7.48	4.06	3.16	3.24	2020/5/12
美國投資級公司債	0.452	-1.061	4.16	-0.07	8.08	5.02	4.49	5.18	2020/5/12
新興市場本地債	0.160	1.011	3.78	2.44	10.88	5.37	4.20	3.56	2020/5/12
新興市場美元債	0.418	2.131	5.05	-9.68	-2.48	1.25	3.37	5.30	2020/5/12
美國高收益債	0.472	1.162	5.01	-8.77	-3.63	1.76	3.47	5.95	2020/5/12
歐洲高收益債	0.015	-0.242	5.81	-9.10	-2.55	2.64	4.04	7.02	2020/5/12

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】