

市場回顧

美國股市

美股下跌 公債殖利率攀升 消費者信心回落

- 標普 500 指數下跌 0.06%，終止連 2 日上漲，過年期間(2/10~2/16)上漲 0.55%。受益於疫苗大規模接種進度優於預期及寬鬆資金行情延續，助長過年期間美股漲勢，不過殖利率攀升降低了部分股市的吸引力，使昨日美股小幅收跌。
- 美國公布 2 月份密西根大學消費者信心指數初值為 76.2，低於 1 月份終值 79 及市場預期的 80.8。密西根大學表示，2 月初消費者信心意外低迷，特別是年收入低於 7.5 萬美元的低薪家庭，因為他們家庭財政狀況顯著惡化，給予拜登政府加速推出新一輪紓困法案的壓力，除此之外，消費者普遍預期通膨將在短期內快速攀升。
- 聯準會(Fed)主席鮑爾 10 日表示，聯準會將繼續以低利率和大規模資產購買計畫支持美國經濟，他強調美國勞動市場目前仍受到新冠肺炎疫情所拖累，認為「有耐心的寬鬆貨幣政策立場」，是讓勞工與低收入階層重返勞動市場的關鍵。彭博分析師指出，按照鮑爾的說法，代表聯準會在近期可預見的未來都不太可能會升息或放慢購債步調。

歐日股市

歐股下跌 日股上漲 日本第四季 GDP 優於預期

- 道瓊歐洲 600 指數下跌 0.06%，終止連 3 日上漲，過年期間(2/10~2/16)上漲 2.14%
- 東證指數上漲 0.57%，連 7 日上漲，累積漲幅 3.13%，過年期間(2/10~2/16)上漲 5.36%；日經指數上漲 1.28%，連 2 日上漲，累積漲幅 3.19%，過年期間(2/10~2/16)上漲 3.26%。日本經濟持續復甦，加上上周已展開新冠疫苗接種計畫，提振日經 225 指數突破 3 萬點大關，為 30 年來首見。日本公布 2020 年第四季實質 GDP 季增年率為 12.7%，遠優於市場預期的 9.5%，連 2 季經濟成長已使日本經濟恢復至接近疫情前水準。而 2020 全年日本經濟萎縮 4.8%，為 2009 年金融危機以來經濟首次出現衰退。

新興市場與亞太股市

新興市場、港股上漲 陸股休市 墨西哥央行降息一碼

- MSCI 新興市場指數上漲 0.31%，連 8 日上漲，累積漲幅 3.93%，過年期間(2/10~2/16)上漲 2.34%；新興亞洲上漲 0.47%，連 8 日上漲，累積漲幅 3.89%，過年期間(2/10~2/16)上漲 2.48%；歐非中東下跌 0.62%，終止連 8 日上漲，過年期間(2/10~2/16)上漲 2.38%；拉丁美洲上漲 0.08%，過年期間(2/10~2/16)上漲 0.78%。墨西哥央行上周宣佈調降基準利率 1 碼至 4%，為去年 9 月來首度降息，符合市場預期。墨西哥央行副行長會後表示，如果通膨保持在預期水準內，則今年至少還有兩次降息空間，再來最快可能會發生在三月份，但仍取決於該國的通膨表現，並且預測今年經濟成長率將超過 5%。
- 恆生指數上漲 1.90%，連 6 日上漲，累積漲幅 5.61%，過年期間(2/10~2/16)上 4.31%；國企指數上漲 1.31%，連 4 日上漲，累積漲幅 4.12%，過年期間(2/10~2/16)上漲 3.74%。陸股休市。
- 澳股上漲 0.70%，連 2 日上漲，累積漲幅 1.61%，過年期間(2/10~2/16)上漲 1.41%。韓股上漲 0.52%，連 3 日上漲，累積漲幅 2.54%，過年期間(2/10~2/16)上漲 2.55%。

債市與匯市

美國公債價格下跌 美元指數上漲

- 美國 10 年期公債殖利率上升 10.59 個基點，至 1.314%，公債價格下跌。美國高收益債下跌 0.022%。
- 美元指數上漲 0.03%至 90.51；歐元貶值 0.19%至 1.2106；日圓貶值 0.62%至 106.04；澳幣貶值 0.30%至 0.7758；南非幣貶值 1.39%至 14.66。

油市與貴金屬

原油價格上漲 黃金價格下跌

- 原油價格上漲 0.98%至 60.05 元。
- 黃金價格下跌 1.34%至 1794.47 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	2828.15	-0.05	0.98	4.17	10.41	18.62	5.13	16.32	2021/2/16
S&P 500	3932.59	-0.06	0.43	4.36	9.69	16.60	4.70	16.34	2021/2/16
道瓊工業	31522.75	0.20	0.44	2.30	6.93	12.86	2.99	7.23	2021/2/16
那斯達克	14047.50	-0.34	0.43	8.07	18.75	27.48	8.99	44.36	2021/2/16
VIX指數	21.46	7.46	1.04	-11.83	-7.10	-2.68	-5.67	56.87	2021/2/16
加拿大TSX綜合	18492.72	0.18	0.89	3.26	10.90	11.98	6.08	3.61	2021/2/16
道瓊歐洲600	419.20	-0.06	2.14	2.78	7.81	13.52	5.05	-2.96	2021/2/16
英國富時	6748.86	-0.11	3.33	0.20	6.03	10.14	4.46	-9.21	2021/2/16
德國DAX	14064.60	-0.32	0.38	2.01	7.09	8.85	2.52	2.04	2021/2/16
法國巴黎	5786.53	0.00	1.67	3.12	5.54	16.38	4.24	-4.92	2021/2/16
日經225	30467.75	1.28	3.67	6.83	17.12	31.91	11.02	29.52	2021/2/16
東證一部指數	1965.08	0.57	2.14	5.84	13.28	22.07	8.89	16.43	2021/2/16
澳洲	6917.27	0.70	0.66	2.78	6.22	13.59	4.79	-3.13	2021/2/16
新興市場股市指數									
新興市場指數	1,442.17	0.31	2.34	6.20	19.88	31.93	11.69	30.36	2021/2/16
新興亞洲指數	810.49	0.47	1.32	7.33	21.40	35.07	13.63	42.35	2021/2/16
新興拉美指數	2,417.86	0.08	0.78	-2.55	13.36	19.93	-1.38	-13.15	2021/2/16
歐非中東指數	259.27	-0.62	1.96	4.21	13.84	19.50	7.46	1.29	2021/2/16
香港恆生	30,746.66	1.90	4.98	7.60	16.40	21.30	12.91	9.97	2021/2/16
香港國企	12,036.15	1.31	4.11	6.32	14.08	15.89	12.09	9.84	2021/2/16
滬深300指數	5,807.72	2.14	5.88	6.74	18.41	24.05	11.44	46.94	2021/2/10
台灣加權	15,802.40	0.61	4.39	2.19	21.80	23.18	7.26	36.08	2021/2/5
韓國KOSPI	3,163.25	0.52	2.33	2.51	24.58	31.39	10.08	41.08	2021/2/16
印度SENSEX	52,104.17	-0.10	1.51	6.26	18.55	36.93	9.12	26.91	2021/2/16
馬來西亞	1,606.14	-0.12	2.09	-1.28	-0.25	2.91	-1.29	4.49	2021/2/16
泰國SET	1,523.11	0.03	0.44	0.26	12.84	15.31	5.09	-0.27	2021/2/16
印尼雅加達綜合	6,292.40	0.35	1.35	-1.27	13.79	19.91	5.24	7.24	2021/2/16
菲律賓綜合股價	7,044.06	1.22	0.28	-2.69	1.22	16.07	-1.34	-3.86	2021/2/16
俄羅斯RTS	1,494.58	-0.12	2.52	1.38	18.76	14.20	7.72	-3.15	2021/2/16
南非40指數	61,775.45	0.16	3.54	5.70	18.14	16.25	13.60	17.99	2021/2/16
巴西聖保羅	119,428.70	0.11	-0.67	-0.76	14.04	17.83	0.35	4.41	2021/2/12
墨西哥Bolsa	44,698.59	1.23	-0.72	-2.60	9.58	14.76	1.43	-0.67	2021/2/16
匯市與油金									
美元指數	90.51	0.03	-0.47	-0.29	-2.30	-2.78	0.64	-8.69	2021/2/16
歐元兌美元	1.2106	-0.19	-0.21	0.13	1.95	1.88	-1.01	11.60	2021/2/16
美元兌日圓	106.04	-0.62	-1.46	-2.31	-1.84	-0.13	-2.72	3.52	2021/2/16
澳幣兌美元	0.7758	-0.30	0.22	0.76	6.00	7.28	0.58	15.27	2021/2/16
美元兌境外人民幣	6.43	-0.30	0.00	1.06	1.85	7.83	1.15	8.65	2021/2/16
美元兌台幣	28.00	-0.03	-0.05	0.06	1.89	5.14	0.33	7.47	2021/2/9
美元兌巴西里爾	5.38	0.14	0.00	-1.06	1.50	1.02	-3.43	-19.05	2021/2/12
美元兌南非蘭德	14.66	-1.39	0.47	3.21	4.85	19.27	0.06	2.06	2021/2/16
西德州原油	60.05	0.98	2.96	14.63	42.49	34.82	23.57	15.51	2021/2/16
黃金現貨	1,794.47	-1.34	-2.88	-2.12	-4.82	-9.85	-5.72	13.19	2021/2/16
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	0.119	1.000	0.39	-1.40	-5.81	-2.60	-0.21	-130.89	2021/2/16
美國10年期公債	1.314	10.590	15.73	23.06	40.80	60.47	40.09	-27.07	2021/2/16
美國30年期公債	2.092	8.320	14.40	25.87	42.90	64.47	44.69	5.27	2021/2/16
德國2年期公債	-0.690	0.500	2.40	3.00	3.10	-4.30	1.00	-3.50	2021/2/16
德國10年期公債	-0.348	3.300	9.80	19.50	19.70	7.30	22.10	5.30	2021/2/16
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	-0.566	-1.257	-2.37	-2.37	3.34	5.24	2.74	3.31	2021/2/16
美國MBS	-0.216	-0.346	-0.22	-0.22	3.03	4.43	2.77	3.06	2021/2/16
美國投資級公司債	-0.489	-0.848	-2.06	-2.06	4.85	7.15	6.20	5.43	2021/2/16
新興市場本地債	-0.203	-0.435	-0.89	-0.89	3.89	5.51	4.79	3.75	2021/2/16
新興市場美元債	-0.507	0.068	-0.86	-0.86	3.08	5.85	7.64	6.17	2021/2/16
美國高收益債	-0.022	1.023	1.41	1.41	6.46	6.52	9.64	6.44	2021/2/16
歐洲高收益債	0.043	1.077	1.58	1.58	4.58	6.45	8.46	7.54	2021/2/16