

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2020年02月26日

市場回顧

美國股市

美股下跌 疫情擔憂持續 消費者信心不及預期

- 標普 500 指數下跌 3.03%，連 4 日下跌，累積跌幅 7.81%。武漢肺炎擔憂持續，美國累計確診人數也來到 53 例，美國疾病管制與預防中心副主任表示，肺炎疫情可能導致全球大流行，在美國爆發只是時間問題，此番言論促使美股跌至當日低點。資金持續轉往債市避險，恐慌指數 VIX 上升至 27.85。
- 美國經濟諮商會公布最新數據，2 月份消費者信心指數自 130.4 升至 130.7，但低於市場預期的 132。消費者信心指數弱於預期主要受到中國境外病例飆增，引發人們對全球經濟走疲的擔憂。不過整體數據仍顯示，由於美國勞動力市場保持強勁，消費者對未來情勢依舊樂觀。

歐日股市

歐、日股下跌 德國 GDP 零成長但企業信心復甦

- 道瓊歐洲 600 指數下跌 1.76%，連 4 日下跌，累積跌幅 6.90%。德國去年第四季 GDP 再度呈現零成長，符合市場預期。但周一公布之 2 月份 Ifo 商業景氣、現況及預期指數分別為 96.1、98.9 及 93.4，皆高於前值及市場預估值，顯示德國企業仍認為，疫情對經濟的影響將僅會是短期性的，並且認為德國景氣將有望擺脫去年的陰霾，於今年開始穩健回溫。然而，本次調查數據並未考慮最新的疫情蔓延狀況，由於近日來義大利的疫情嚴重擴大，導致義大利政府宣佈封鎖 11 個行政區，其中包含兩座工業重鎮，產值共計佔義大利 GDP 的 30%，因此後續狀況仍有待觀察。
- 東證指數下跌 3.33%，連 2 日下跌，累積跌幅 3.36%；日經指數下跌 3.34%，連 2 日下跌，累積跌幅 3.73%。受武漢肺炎疫情急速升溫影響，加上周一日股休市，昨日補跌，日股創 14 個月以來最大單日跌幅。

新興市場 與 亞太股市

新興市場、港股上漲 陸股下跌 印尼擴大財政刺激

- MSCI 新興市場指數上漲 0.12%，終止連 3 日下跌；新興亞洲上漲 0.53%，終止連 3 日下跌；歐非中東下跌 1.43%，連 4 日下跌，累積跌幅 6.01%；拉丁美洲下跌 0.65%，連 4 日下跌，累積跌幅 4.39%。由於武漢疫情的擴大，對印尼的旅遊觀光業、航空業、以及不動產業者皆造成重創，因此印尼政府昨日宣佈，將實施 10.3 兆印尼盾(7.42 億美元)的財政刺激計劃，並針對位於十大觀光景點的旅館及餐廳業者，實施為期 3 個月的稅務減免措施，受疫情擴大的影響，印尼央行也於上周也調降了今年 GDP 成長預估值，由疫情爆發前所預估的 5.3%，調降至 5%-5.4%區間。印尼於去年全年的 GDP 成長率為 5.02%。
- 恆生指數上漲 0.34%，終止連 3 日下跌；國企指數上漲 0.15%，終止連 2 日下跌。滬深 300 指數下跌 0.22%，連 2 日下跌，累積跌幅 0.62%。
- 澳股下跌 1.60%，連 3 日下跌，累積跌幅 4.18%。韓股上漲 1.18%，終止連 3 日下跌。南韓公布 2 月消費者信心指數，由 1 月份 104.2 急跌至 96.9，創下去年 8 月來新低，主要因為疫情擴大，使市場信心流失，反映出多數人認為經濟前景不樂觀。

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 1.84 個基點，至 1.352%，公債價格上漲。
- 美元指數下跌 0.39%至 98.968；歐元升值 0.26%至 1.088；日圓升值 0.47%至 110.20；澳幣貶值 0.02%至 0.66；南非幣貶值 0.43%至 15.215。

油市 與貴金屬

原油價格、黃金價格下跌

- 原油價格下跌 2.97%至 49.90 元。
- 黃金價格下跌 1.46%至 1635.14 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	2269.42	-2.63	-6.66	-5.26	-0.93	8.34	-3.78	8.49	2020/2/25
S&P 500	3128.21	-3.03	-7.18	-5.08	-0.39	8.68	-3.17	11.97	2020/2/25
道瓊工業	27081.36	-3.15	-7.36	-6.58	-3.70	4.57	-5.11	3.93	2020/2/25
那斯達克	8965.61	-2.77	-7.88	-3.75	3.67	14.16	-0.08	18.76	2020/2/25
VIX指數	27.85	11.27	87.80	91.28	141.33	44.15	102.10	83.59	2020/2/25
加拿大TSX綜合	17177.37	-2.19	-3.81	-2.21	0.83	6.70	0.67	6.90	2020/2/25
道瓊歐洲600	404.60	-1.76	-5.98	-4.49	-0.95	8.97	-2.70	8.29	2020/2/25
英國富時	7017.88	-1.94	-4.93	-7.49	-5.20	-1.09	-6.95	-1.86	2020/2/25
德國DAX	12790.49	-1.88	-6.51	-5.79	-3.37	9.71	-3.46	10.83	2020/2/25
法國巴黎	5679.68	-1.94	-6.23	-5.72	-4.22	6.14	-4.99	8.42	2020/2/25
日經225	22605.41	-3.34	-3.90	-5.13	-3.29	11.57	-4.44	5.39	2020/2/25
東證一部指數	1618.26	-3.33	-4.12	-6.48	-5.13	9.49	-5.99	0.07	2020/2/25
澳洲	6866.60	-1.60	-5.52	-4.80	-0.55	4.82	0.99	10.15	2020/2/25
新興市場股市指數									
新興市場指數	1,056.54	0.12	-3.57	-5.61	0.29	8.51	-5.21	-1.04	2020/2/25
新興亞洲指數	545.04	0.53	-3.94	-4.47	1.72	10.98	-3.72	1.43	2020/2/25
新興拉美指數	2,656.12	-0.65	-3.87	-8.21	-1.17	4.89	-8.97	-8.15	2020/2/25
歐非中東指數	241.69	-1.43	-5.91	-9.34	-5.46	-0.29	-9.67	-6.92	2020/2/25
香港恆生	26,893.23	0.27	-2.31	-3.78	-0.08	4.72	-4.60	-6.53	2020/2/25
香港國企	10,579.92	0.11	-2.08	-3.61	-0.35	5.66	-5.27	-8.35	2020/2/25
滬深300指數	4,123.85	-0.22	1.64	3.00	5.97	9.50	0.67	11.92	2020/2/25
台灣加權	11,540.23	0.05	-0.93	-4.77	-0.32	11.45	-3.81	11.05	2020/2/25
韓國KOSPI	2,103.61	1.18	-4.83	-6.35	-0.84	9.77	-4.28	-5.52	2020/2/25
印度SENSEX	40,281.20	-0.20	-1.89	-3.20	-1.32	7.43	-2.36	11.97	2020/2/25
馬來西亞	1,500.88	0.73	-2.36	-4.57	-5.24	-6.23	-5.53	-12.69	2020/2/25
泰國SET	1,439.10	0.25	-4.93	-8.31	-10.58	-11.32	-8.91	-13.49	2020/2/25
印尼雅加達綜合	5,787.14	-0.34	-1.70	-7.32	-3.97	-6.88	-8.13	-11.52	2020/2/25
菲律賓綜合股價	7,187.44	-2.47	-1.90	-5.72	-7.52	-8.90	-8.03	-9.73	2020/2/24
俄羅斯RTS	1,446.11	-5.16	-6.29	-9.61	0.36	14.02	-6.64	21.21	2020/2/25
南非40指數	49,303.27	0.04	-5.04	-3.73	-1.03	2.62	-2.98	-1.33	2020/2/25
巴西聖保羅	113,681.40	-0.79	-0.61	-3.97	4.59	16.40	-1.70	16.14	2020/2/21
墨西哥Bolsa	43,045.68	-1.76	-4.29	-4.64	0.45	7.39	-1.14	-1.32	2020/2/25
匯市與油金									
美元指數	98.968	-0.39	-0.47	1.14	0.66	1.36	2.68	2.65	2020/2/25
歐元兌美元	1.088	0.26	0.68	-1.28	-1.30	-2.02	-2.99	-4.49	2020/2/25
美元兌日圓	110.200	0.47	0.99	-1.25	-1.12	-3.77	-1.51	0.28	2020/2/25
澳幣兌美元	0.660	-0.02	-1.06	-2.32	-2.71	-2.52	-5.94	-8.10	2020/2/25
美元兌境外人民幣	7.026	0.15	-0.18	-0.55	-0.16	2.01	-0.91	-4.83	2020/2/25
美元兌台幣	30.369	0.31	-0.84	-0.88	0.43	3.48	-1.24	1.35	2020/2/25
美元兌巴西里爾	4.389	0.03	-2.20	-3.98	-4.40	-8.21	-8.29	-14.25	2020/2/21
美元兌南非蘭德	15.215	-0.43	-1.55	-4.01	-2.75	0.45	-8.01	-9.11	2020/2/25
西德州原油	49.900	-2.97	-6.26	-7.49	-13.12	-3.76	-17.00	-13.00	2020/2/25
黃金現貨	1,635.14	-1.46	1.70	4.30	12.16	7.32	8.03	23.34	2020/2/25
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	1.225	-2.280	-18.68	-26.99	-38.86	-30.84	-34.43	-128.10	2020/2/25
美國10年期公債	1.352	-1.840	-20.89	-33.18	-40.30	-18.30	-56.54	-131.05	2020/2/25
美國30年期公債	1.825	-0.930	-18.57	-30.70	-37.59	-19.98	-56.42	-120.17	2020/2/25
德國2年期公債	-0.687	-1.400	-4.20	-7.50	-6.00	20.50	-8.60	-12.90	2020/2/25
德國10年期公債	-0.512	-3.100	-10.50	-17.70	-16.30	16.30	-32.70	-62.00	2020/2/25
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	0.310	1.422	4.02	4.02	10.82	4.40	2.97	3.44	2020/2/25
美國MBS	0.072	0.471	1.20	1.20	6.85	3.47	2.72	3.16	2020/2/25
美國投資級公司債	0.055	1.177	3.58	3.58	15.35	6.61	4.92	5.76	2020/2/25
新興市場本地債	0.050	0.937	2.26	2.26	11.36	5.70	3.91	3.69	2020/2/25
新興市場美元債	-0.230	0.742	2.35	2.35	12.54	6.39	6.57	6.96	2020/2/25
美國高收益債	-0.238	0.219	0.22	0.22	8.10	5.46	5.60	7.36	2020/2/25
歐洲高收益債	-0.206	0.330	0.76	0.76	10.89	6.99	6.32	8.59	2020/2/25