

全球金融市場週報

2022年10月17日



美國通膨持續高漲，靜待美企業第三季財報結果

國際油價受IEA下調第四季和明年全球原油需求預估影響下跌

2022/10/14		全球市場概覽							
市場		Price	1D	1W	1M	3M	YTD	1Y	
股市	全球股市	552.1	-1.2%	-1.9%	-9.3%	-7.8%	-26.9%	-24.0%	
	區域型								
		成熟市場	2376.7	-1.5%	-1.7%	-9.2%	-7.5%	-26.5%	-23.0%
		新興市場	863.3	1.0%	-3.8%	-10.3%	-10.2%	-29.9%	-31.8%
		亞太不含日	445.2	1.4%	-3.9%	-11.0%	-12.2%	-29.3%	-30.7%
		新興歐	68.9	3.1%	-0.1%	-7.9%	-2.3%	-79.5%	-82.2%
		拉美	2122.0	-1.4%	-3.8%	-2.3%	8.7%	-0.4%	-5.5%
		美國							
		S&P 500	3583.1	-2.4%	-1.6%	-9.2%	-7.3%	-24.8%	-19.3%
		DJIA	29634.8	-1.3%	1.2%	-4.8%	-5.3%	-18.4%	-15.1%
		NASDAQ	10321.4	-3.1%	-3.1%	-11.9%	-9.9%	-34.0%	-30.4%
		歐洲							
		道瓊歐洲	391.3	0.6%	-0.1%	-6.3%	-5.4%	-19.8%	-16.0%
		德國DAX	12437.8	0.7%	1.3%	-4.5%	-3.3%	-21.7%	-19.6%
		法國CAC	5931.9	0.9%	1.1%	-4.7%	-1.7%	-17.1%	-11.3%
		英國富時	6858.8	0.1%	-1.9%	-5.8%	-4.2%	-7.1%	-4.8%
		亞太							
		日本日經225	27090.8	3.3%	-0.1%	-2.6%	1.1%	-5.9%	-5.1%
		中國上證	3072.0	1.8%	1.6%	-5.1%	-4.8%	-15.6%	-13.7%
		中國滬深300	3842.5	2.4%	1.0%	-5.5%	-9.6%	-22.2%	-21.8%
		香港恆生	16587.7	1.2%	-6.5%	-12.0%	-18.3%	-29.1%	-33.5%
		台灣	13128.1	2.5%	-4.2%	-10.4%	-9.8%	-27.9%	-19.9%
		印度	57920.0	1.2%	-0.5%	-4.0%	7.7%	-0.6%	-5.5%
		其他新興市場							
		巴西	112072.3	-1.9%	-3.7%	1.4%	16.1%	6.9%	-1.0%
		俄羅斯	990.7	2.3%	-1.4%	-22.8%	-14.7%	-37.9%	-47.2%
		實體資產							
	全球REITs	977.7	-2.1%	-2.5%	-17.4%	-18.0%	-34.8%	-28.0%	
	美國REITs	1056.1	-2.4%	-1.0%	-15.3%	-14.9%	-33.0%	-26.6%	
	全球基礎建設	1643.8	-0.6%	-1.9%	-14.0%	-13.4%	-16.2%	-14.1%	
商品	Brent	91.6	-3.1%	-6.4%	-2.6%	-9.4%	17.8%	9.1%	
	WTI	85.6	-3.9%	-7.6%	-3.2%	-12.3%	13.8%	5.3%	
	黃金	1644.5	-1.3%	-3.0%	-3.1%	-3.7%	-10.1%	-8.4%	

- 美國股市因通膨數據持續高漲，及美國10年公債殖利率升至4%影響而表現疲弱；St. Louis Fed總裁Bullard表示，FOMC不排除在今年11月、12月利率決策會議各宣布升息三碼，而PCE價格指數年增率明年將有望降至3%以下。美國三大指數上週漲跌互見，DJIA指數週漲1.2%，S&P500指數週跌1.6%，NASDAQ指數週跌3.1%。
- 美國第三季超級財報週於上週五開始，大型銀行股公布財報表現參差，JPMorgan和Wells Fargo的信貸損失準備金高於預期，反映借款人償還債務能力的不確定性增加，經濟前景不明。Refinitiv的IBES資料顯示，S&P500成份股Q3企業獲利預估年增3.6%，低於Q2年增11.1%。
- 國際能源署(IEA)月報表示，受全球經濟惡化及OPEC+減產導致油價偏高的影響，下調Q4和明年全球原油需求預估。WTI週跌7.6%、Brent週跌6.4%。

美國9月核心CPI創40年高，今年利率或再升6碼


英國財政部長遭解職，日圓受美國升息預期續貶至32年新低；債市普跌

2022/10/14		全球市場概覽							
市場	Price	1D	1W	1M	3M	YTD	1Y		
匯率	美元指數	113.31	0.8%	0.5%	3.3%	4.9%	18.4%	20.6%	
	歐元	0.97	-0.6%	-0.2%	-2.6%	-3.6%	-14.5%	-16.2%	
	英鎊	1.12	-1.4%	0.8%	-3.2%	-5.8%	-17.4%	-18.3%	
	日圓	148.67	-1.1%	-2.4%	-3.9%	-7.3%	-29.2%	-30.8%	
	澳幣	0.62	-1.6%	-2.8%	-8.1%	-8.7%	-14.6%	-16.4%	
	人民幣	7.22	-0.6%	-1.2%	-3.5%	-6.8%	-13.6%	-12.2%	
	台幣	31.90	0.0%	-0.7%	-2.6%	-6.5%	-15.2%	-13.5%	
	印度盧比	82.34	0.0%	0.0%	-3.6%	-3.1%	-10.8%	-9.4%	
	巴西里爾	5.33	-1.2%	-2.4%	-3.1%	1.5%	4.5%	3.4%	
	俄羅斯盧布	62.83	1.3%	-1.0%	-4.2%	-10.2%	16.4%	12.0%	
債市	信用債	全球複合債	418.81	-0.2%	-1.4%	-5.3%	-8.1%	-21.3%	-21.9%
		全球投資債	274.75	-0.2%	-1.5%	-5.7%	-7.9%	-22.2%	-22.6%
		全球高收益	368.04	0.2%	-1.3%	-4.8%	-2.8%	-19.0%	-19.0%
		美國高收益	1352.64	0.2%	-1.1%	-3.7%	-2.2%	-14.3%	-13.6%
		Crossover	546.59	-0.1%	-1.7%	-6.2%	-2.5%	-24.5%	-24.7%
		新興債	993.34	-0.2%	-1.7%	-6.0%	-3.8%	-21.6%	-21.5%
		亞債	211.25	-0.3%	-1.7%	-5.2%	-4.6%	-17.9%	-17.1%
	利率債	美國2年期公債	4.50	3	19	71	138	376	414
		美國10年期公債	4.02	7	14	61	110	251	251
		10年-2年公債利差	-47.75	4	-5	-9	-27	-126	-163
歐洲10年期公債		2.34	6	15	63	121	253	254	
日本10年期公債	0.25	0	0	-1	2	18	17		

- 美國勞工統計局上週四(10/13)公布，9月CPI年增8.2% (未經季調)，高於市場預期的8.1%；扣除食品和能源的核心CPI年增6.6%，高於市場預期的6.5%和前值6.3%，創1982年8月以來新高。CPI月增0.4%(經季調)，高於市場預期的0.2%；核心CPI月增0.6%、高於市場預期的0.5%。
- 物價指數高於預期使聯準會12月連五次升息3碼的機率升至66.7%。美國2年期公債殖利率上週續升19bps至4.50%，創2007年8月以來新高；10年期公債殖利率週升14bps破4%關卡至4.02%創2008年10月新高；債市普跌。
- 英國首相Liz Truss上週五將財政部長Kwarteng解職，並宣布維持上屆政府提高企業稅的計畫。英國匯市和債市持續動盪；日圓受美國升息預期續貶至32年新低，美元指數週漲0.5%。

免責聲明

本報告所載係根據各項市場資訊或本諸我們所相信之可靠來源，加以整理、彙集及研究分析，僅供參考，本公司不保證其正確性和完整性。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、建議或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，本公司或相關企業與其任何董事或受僱人，並不負任何法律責任。本項內容所載資料或任何部份，未經授權均不得抄錄、翻印、轉載或另作宣傳等引用，違反者追究其法律責任。

 NAVIGATE 展新證券投資顧問股份有限公司

111金管投顧新字第001號 台北市信義區忠孝東路五段508號14-1樓

Tel: (02)2727-1580 Fax: (02)2751-0986

