

全球金融市場週報

2022年10月11日



美國就業市場強勁，市場預期貨幣政策持續緊縮

JPMorgan執行長示警全球經濟將衰退；OPEC+達成減產協議推升油價大漲

2022/10/7		全球市場概覽							
市場		Price	1D	1W	1M	3M	YTD	1Y	
股市	全球股市	563.0	-2.3%	1.7%	-7.4%	-7.5%	-25.4%	-21.6%	
	區域型								
		成熟市場	2417.7	-2.4%	1.6%	-7.5%	-7.1%	-25.2%	-20.6%
		新興市場	897.7	-1.4%	2.5%	-6.1%	-10.2%	-27.1%	-28.4%
		亞太不含日	463.0	-1.4%	2.3%	-6.8%	-11.9%	-26.5%	-27.2%
		新興歐	69.0	-0.9%	5.1%	-5.3%	-6.6%	-79.5%	-82.0%
		拉美	2206.6	-1.3%	7.4%	3.5%	8.0%	3.6%	0.3%
		美國							
		S&P 500	3639.7	-2.8%	1.5%	-8.5%	-6.7%	-23.6%	-17.3%
		DJIA	29296.8	-2.1%	2.0%	-7.2%	-6.5%	-19.4%	-15.7%
		NASDAQ	10652.4	-3.8%	0.7%	-9.7%	-8.4%	-31.9%	-27.3%
		歐洲							
		道瓊歐洲	391.7	-1.2%	1.0%	-4.9%	-6.1%	-19.7%	-14.6%
		德國DAX	12273.0	-1.6%	1.3%	-5.0%	-5.7%	-22.7%	-19.5%
		法國CAC	5866.9	-1.2%	1.8%	-3.9%	-2.8%	-18.0%	-11.1%
		英國富時	6991.1	-0.1%	1.4%	-3.4%	-2.9%	-5.3%	-1.2%
		亞太							
		日本日經225	27116.1	-0.7%	4.5%	-1.1%	2.3%	-5.8%	-2.0%
		中國上證	3024.4	0.0%	0.0%	-6.8%	-9.9%	-16.9%	-15.2%
		中國滬深300	3804.9	0.0%	0.0%	-6.2%	-14.1%	-23.0%	-21.8%
		香港恆生	17740.1	-1.5%	3.0%	-6.8%	-18.3%	-24.2%	-28.2%
		台灣	13702.3	-1.4%	2.1%	-4.9%	-5.3%	-24.8%	-18.0%
		印度	58191.3	-0.1%	1.3%	-1.4%	6.8%	-0.1%	-2.5%
		其他新興市場							
		巴西	116375.3	-1.0%	5.8%	6.0%	16.0%	11.0%	5.2%
		俄羅斯	1005.0	-3.8%	-4.8%	-19.2%	-12.2%	-37.0%	-45.8%
		實體資產							
	全球REITs	1003.1	-2.3%	-3.5%	-17.6%	-16.4%	-33.2%	-24.4%	
	美國REITs	1067.1	-2.3%	-3.0%	-16.9%	-14.4%	-32.3%	-23.6%	
	全球基礎建設	1676.5	-1.5%	0.7%	-12.1%	-12.1%	-14.5%	-12.2%	
商品	Brent	97.9	3.7%	11.3%	11.3%	-8.5%	25.9%	19.5%	
	WTI	92.6	4.7%	16.5%	13.1%	-11.6%	23.2%	18.3%	
	黃金	1694.8	-1.0%	2.1%	-1.4%	-2.7%	-7.3%	-3.5%	

- 美國股市受9月非農就業新增人數超預期，使投資人擔憂聯準會積極升息，再加上美國針對中國半導體產業宣布出口禁令持續衝擊晶片類股，抵銷美國三大指數上週前半週的漲幅，全週上漲1%~2%。JPMorgan執行長Jamie Dimon 10日警告，美國及全球經濟恐在6~9個月後陷入衰退。Fed副主席Brainard亦表示，開始觀察到就業市場有降溫跡象，而貨幣政策效用延遲發揮，意味升息將在未來幾個月對房市以外產業產生愈來愈大衝擊。
- 美國第三季超級財報週將於週五(10/14)開始，Refinitiv的IBES資料顯示，分析師預測標普500大企業Q3每股盈餘僅年增4.1%，不如7月初預估的11.1%。
- OPEC+上週達成自11月起每日減產200萬桶的協議，為2020年新冠疫情爆發以來最大減產幅度，推升國際油價大漲。WTI週漲16.5%、Brent週漲11.3%。

美國9月非農新增就業人數超預期，失業率創新低


美元指數因就業市場強勁維持強勢，債市漲跌互見

2022/10/7		全球市場概覽							
市場	Price	1D	1W	1M	3M	YTD	1Y		
匯率	美元指數	112.80	0.5%	0.6%	2.7%	5.4%	17.9%	19.7%	
	歐元	0.97	-0.5%	-0.6%	-2.6%	-4.3%	-14.3%	-15.7%	
	英鎊	1.11	-0.7%	-0.8%	-3.9%	-7.9%	-18.1%	-18.6%	
	日圓	145.25	-0.1%	-0.4%	-1.1%	-6.7%	-26.2%	-30.1%	
	澳幣	0.64	-0.5%	-0.4%	-5.8%	-7.0%	-12.2%	-12.8%	
	人民幣	7.13	-0.7%	0.1%	-2.5%	-6.7%	-12.2%	-10.6%	
	台幣	31.68	-0.5%	0.3%	-2.4%	-6.3%	-14.4%	-13.3%	
	印度盧比	82.33	-0.5%	-1.2%	-3.0%	-3.9%	-10.8%	-10.1%	
	巴西里爾	5.20	0.4%	3.9%	0.9%	1.0%	6.7%	5.7%	
	俄羅斯盧布	62.18	-0.4%	-3.4%	-0.8%	2.5%	17.3%	13.3%	
債市	信用債	全球複合債	424.83	-0.6%	-0.4%	-4.2%	-6.7%	-20.2%	-20.6%
		全球投資債	278.86	-0.6%	0.0%	-4.6%	-6.0%	-21.0%	-21.2%
		全球高收益	372.77	-0.6%	1.2%	-3.3%	-1.9%	-18.0%	-18.1%
		美國高收益	1367.47	-0.5%	1.4%	-2.6%	-0.8%	-13.4%	-12.6%
		Crossover	555.79	-0.5%	0.7%	-4.5%	-2.8%	-23.3%	-23.3%
		新興債	1010.43	-0.4%	0.3%	-4.6%	-3.5%	-20.2%	-20.2%
		亞債	214.95	-0.5%	-0.3%	-3.7%	-3.9%	-16.4%	-16.1%
	利率債	美國2年期公債	4.31	5	3	88	120	358	400
		美國10年期公債	3.88	6	5	62	80	237	231
		10年-2年公債利差	-42.64	1	2	-26	-40	120	169
歐洲10年期公債		2.19	11	9	62	85	237	238	
日本10年期公債	0.25	0	1	0	1	18	18		

- 美國勞工部7日公布，9月非農新增就業人數為26.3萬人，雖低於前值31.5萬人，但高於市場預期的25萬人。失業率3.5%，低於市場預期的3.7%，且較8月的3.7%進一步下降，回落至歷史新低，顯示美國就業市場仍相當強勁。雖上週(截至10/1)首次申請失業救濟金人數自前週下修值19萬人升至21.9萬人，高於預期，但市場仍預期聯準會的貨幣政策將繼續維持鷹派緊縮政策。
- 據FedWatch 10/10數據顯示，市場對11月聯準會升息3碼的預期達78%。美國2年期公債殖利率上週續升3bps至4.31%；10年期公債殖利率週升5bps至3.88%。債市漲跌互見。美國債市10/10因哥倫布日休市一天。
- 美元指數因就業市場強勁維持強勢；英國央行10日宣布將每日購債上限翻倍至100億英鎊，但英鎊兌美元仍連續4個交易日下跌，上週下跌0.8%。

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