

研究部

报告摘要

胡悦

yhu@cebm.com.cn

边泉水

qsbian@cebm.com.cn

关于莫尼塔研究

莫尼塔研究是财新集团旗下的独立研究公司。

自 2005 年成立伊始，莫尼塔研究一直为全球大型投资机构及各类企业提供资本市场投资策略，信息数据以及产业相关的研究服务。

我们的客户包括国内外大型资产管理公司，保险公司，私募基金及各类企业。

2015 年莫尼塔研究加入财新集团，成为中国最具影响力的财经媒体集团+顶级智库的一员。

www.caixininsight.com

- 上周美股三大指数均涨幅较大，其中纳指涨幅最高，高达 3.19%，标普 500 上涨 2.28%，道指上涨 1.65%。欧股市场同样表现强势，富时 100 收涨 1.41%，法国收涨 2.31%，德国上涨 1.45%。亚洲股市涨跌幅较小，日经收涨 0.83%，韩国收跌 0.18%，恒生指数收涨，达 0.13%。新兴市场表现弱势，俄罗斯下挫 0.55%，巴西市场跌幅 2.15%，印度指数上涨 0.20%。前期市场对于货币政策担忧以及新型冠状病毒有所减缓，发达地区股市表现强势，但亚洲及新兴市场小幅下挫。
- 十年美债收益率由 1.40% 上升 9 个 bps 至 1.49%，美国长债上方压力减弱；德国国债收益率大幅上涨 12.8%，日本十年国债收益率回落至 0.06%。美债期限利差扩大 4 个 bps 至 0.80%。
- 美元指数小幅下跌，最终收于 96.1327。澳元、欧元兑美元均出现升值，澳元涨幅 1.35%，欧元小幅收涨 0.72%，日元兑美元继续下挫 0.56%，人民币兑美元上涨，涨幅为 0.12%，英镑涨幅为 1.16%。美元指数快速上涨告一段落，市场对于加息预期的担忧有所缓解。
- 贵金属方面，美国 PCE 续创新高并超出市场预期，但金价小幅下行，黄金周度跌幅为 0.33%，白银持续上升，收涨 0.09%，收于 22.67 美元/盎司。LME 铜维持震荡走势，小幅收涨 1.56%，收于 9597 美元，美原油经历暴跌后又暴涨，涨幅为 5.16%，最终收于 73.76 美元。整体商品表现强势，市场对于新变异病毒担忧基本消化完毕，原油维持强势。



目录

一、 全球市场高频数据跟踪.....	3
二、 大类资产回顾.....	3

图表目录

图表 1：高频数据更新.....	3
图表 2：美股三大指数上涨	4
图表 3：欧洲股市大幅上涨	4
图表 4：亚太地区股市情况	4
图表 5：新兴市场股市走势	4
图表 6：美债收益率上升	5
图表 7：美债期限利差走高	5
图表 8：美元指数小幅下跌	5
图表 9：上周美元下行	5
图表 10：金银价格有所分化	6
图表 11：大宗商品大幅上涨	6

一、全球市场高频数据跟踪

图表 1：高频数据更新

	收盘价	1D%	1W%	1M%		收盘价	1D%	1W%	1M%
MSCI 全球	874.8	-0.02%	1.81%	2.02%	MSCI 亚太地区	180.5	-0.03%	0.37%	-2.68%
MSCI 发达市场	2445.3	-0.01%	2.04%	2.37%	MSCI 新兴市场	69444.9	-0.06%	0.02%	-0.64%
美股	收盘价	1D%	1W%	1M%	VIX	收盘价	1D%	1W%	1M%
道指	35950.56	0.55%	1.65%	5.67%	道指 VIX	17.96	-4.42%	-12.98%	-29.40%
纳指	15653.37	0.85%	3.19%	2.62%	纳指 VIX	21.32	-3.75%	-15.53%	-25.06%
标普 500	4725.79	0.62%	2.28%	4.71%	标普 500VIX	17.96	-3.60%	-12.69%	-37.25%
欧洲股市	收盘价	1D%	1W%	1M%	新兴市场	收盘价	1D%	1W%	1M%
英国富时 100	7372.1	1.25%	1.41%	4.43%	印度 SENSEX	57124.31	-0.33%	0.20%	-0.99%
法国 CAC40	7086.58	1.12%	2.31%	5.44%	巴西 IBOVESPA 指数	104891.3	0.00%	-2.15%	-0.17%
德国 DAX	15756.31	1.03%	1.45%	4.35%	俄罗斯 MOEX	3702.72	-0.05%	-0.55%	-5.38%
亚洲股市	收盘价	1D%	1W%	1M%	利率	收盘价	1D%	1W%	1M%
日经 225	28782.59	-0.05%	0.83%	3.45%	十年美债收益率	1.41	-2.08%	-4.73%	-8.44%
韩国综合指数	3012.43	0.48%	-0.18%	6.11%	十年 TIPS 收益率	-0.97	-1.02%	1.04%	-12.61%
恒生指数	23223.76	0.13%	0.13%	-1.07%	Libor USD 0/N	0.08	13.84%	11.22%	3.48%
汇率	收盘价	1D%	1W%	1M%	Libor USD 3M	0.22	2.25%	7.55%	27.12%
美元指数	96.13	0.08%	-0.56%	0.07%	中美利差	1.24	-11.04%	-8.31%	-10.38%
人民币指数	123.88	-0.05%	0.06%	0.06%					

来源：Wind，莫尼塔研究

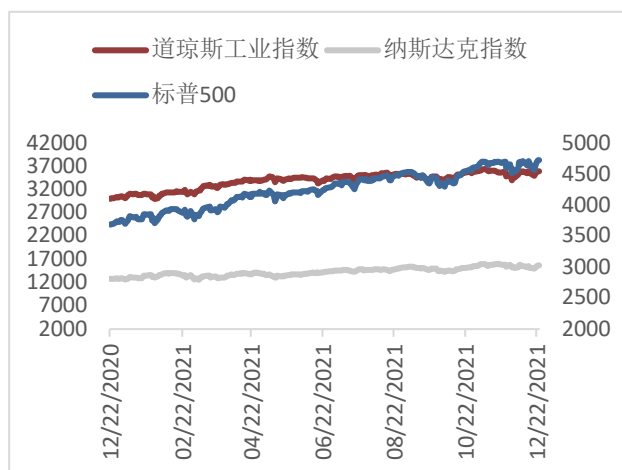
二、大类资产回顾

1. 股票市场

上周美股三大指数均涨幅较大，其中纳指涨幅最高，高达 3.19%，标普 500 上涨 2.28%，道指上涨 1.65%。

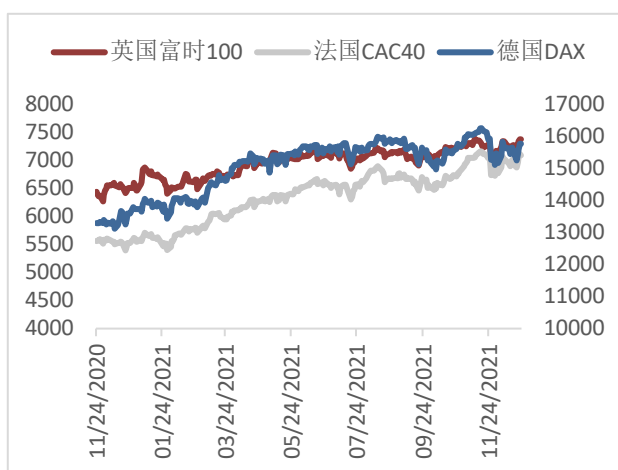
欧股市场同样表现强势，富时 100 收涨 1.41%，法国收涨 2.31%，德国上涨 1.45%。亚洲股市涨跌幅较小，日经收涨 0.83%，韩国收跌 0.18%，恒生指数收涨，达 0.13%。新兴市场表现弱势，俄罗斯下挫 0.55%，巴西市场跌幅 2.15%，印度指数上涨 0.20%。前期市场对于货币政策担忧以及新型冠状病毒有所减缓，发达地区股市表现强势，但亚洲及新兴市场小幅下挫。

图表 2：美股三大指数上涨



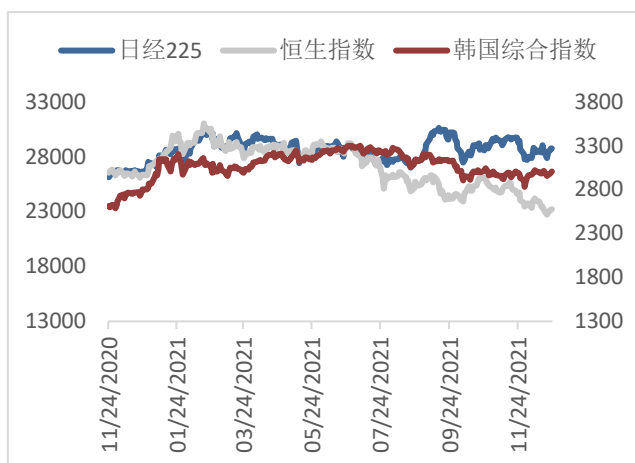
来源：Wind，莫尼塔研究

图表 3：欧洲股市大幅上涨



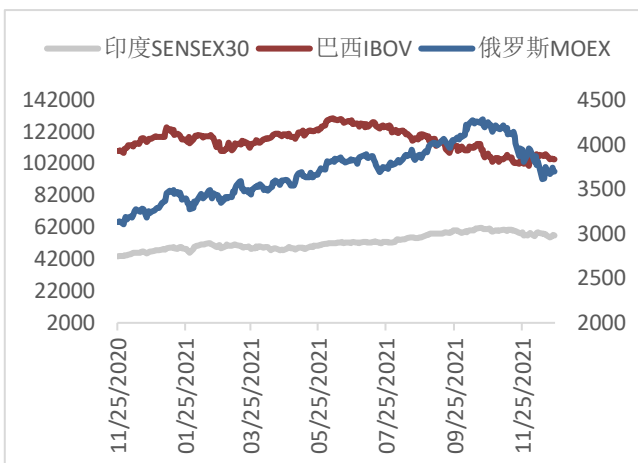
来源：Wind，莫尼塔研究

图表 4：亚太地区股市情况



来源：Wind，莫尼塔研究

图表 5：新兴市场股市走势

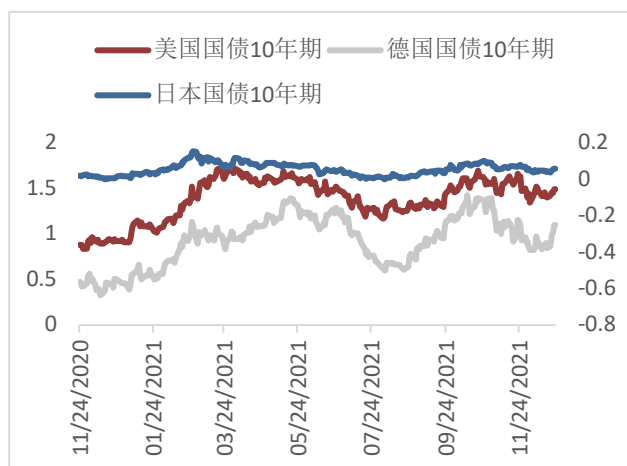


来源：Wind，莫尼塔研究

2. 债券市场

十年美债收益率由 1.40% 上升 9 个 bps 至 1.49%，美国长债上方压力减弱；德国国债收益率大幅上涨 12.8%，日本十年国债收益率回落至 0.04%。美债期限利差扩大 4 个 bps 至 0.80%。

图表 6：美债收益率上升



来源：Wind，莫尼塔研究

图表 7：美债期限利差走高

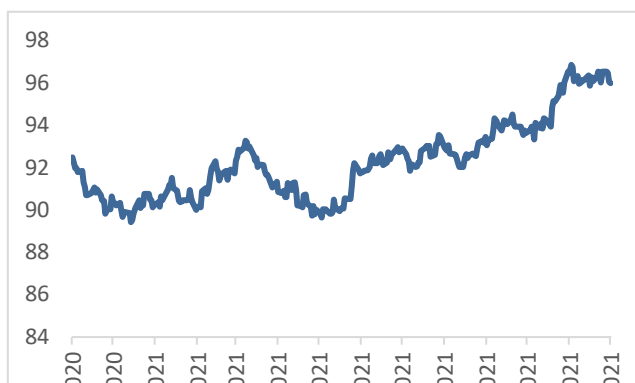


来源：Wind，莫尼塔研究

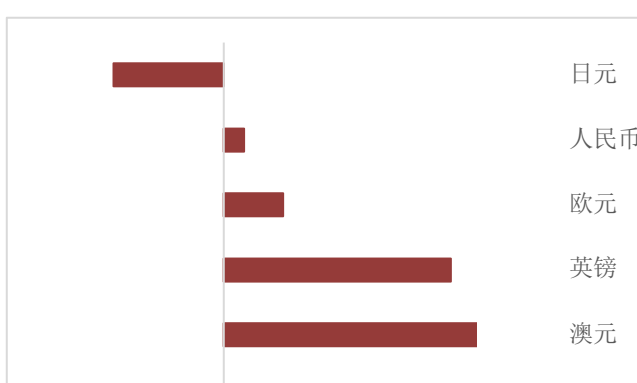
3. 外汇市场

美元指数小幅下跌，最终收于 96.1327。澳元、欧元兑美元均出现升值，澳元涨幅 1.35%，欧元小幅收涨 0.72%，日元兑美元继续下挫 0.56%，人民币兑美元上涨，涨幅为 0.12%，英镑涨幅为 1.16%。美元指数快速上涨告一段落，市场对于加息预期的担忧有所缓解。

图表 8：美元指数小幅下跌



图表 9：上周美元下行



预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_35347

