

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2020年06月02日

市場回顧

美國股市

美股上漲 ISM 製造業 PMI 攀升

- 標普 500 指數上漲 0.38%，連 2 日上漲，累積漲幅 0.86%，受經濟重啟的樂觀情緒推升。
- 美國供應商管理協會(ISM)公布 5 月製造業採購經理人指數(PMI)為 43.1，符合市場預期，儘管自上月的 11 年低點反彈，但仍遠低於 50 景氣分水線，不過四個月以來的首度上升顯示隨著各州重啟經濟、企業開始營運後，產業最糟情況已逐漸退去。
- 美國商務部公布，4 月個人消費支出萎縮達 13.6%，創下歷來最大降幅，萎縮幅度亦高於市場預期的 12.6%。
- 花旗集團警告表示，面對艱難的時期，股市卻「遙遙領先」，與經濟基本面大幅脫節，建議企業在市場意識到疫情的真正成本之前，盡可能發債或增資，以籌集更多的資金。根據 Refinitiv 數據顯示，今年以來，投資級公司的美國公司債發行量已經超過了一兆美元，高於 2019 年同期的 5400 億美元，並且接近過去五年平均的 1.3 兆美元的水平。

歐日股市

歐、日股上漲 歐元區製造業 PMI 反彈 日本 PMI 持續惡化

- 道瓊歐洲 600 指數上漲 1.10%。IHS Markit 公布，歐元區 5 月製造業採購經理人指數 (PMI) 終值為 39.4，從 4 月創下的近 22 年低點 33.4 反彈，但距離 50 榮枯分界線仍然遙遠，意味著復甦仍有長路要走。
- 東證指數上漲 0.32%；日經指數上漲 0.84%。日本公布 5 月份製造業 PMI 為 38.4，較前月的 41.9 更加惡化，也是連續 4 個月出現負成長。

新興市場
與
亞太股市

新興市場、港、陸股上漲 中國 PMI 雙重回擴張區

- MSCI 新興市場指數上漲 2.27%，連 2 日上漲，累積漲幅 2.81%；新興亞洲上漲 2.20%，連 2 日上漲，累積漲幅 3.28%；歐非中東上漲 2.47%；拉丁美洲上漲 2.64%。
- 恆生指數上漲 3.36%，終止連 3 日下跌；國企指數上漲 2.85%，連 2 日上漲，累積漲幅 2.95%；滬深 300 指數上漲 2.70%，連 3 日上漲，累積漲幅 3.26%。因川普針對「港版國安法」祭出的制裁力道不如外界預期，利多消息帶動 A 股三大指數全面大漲，北向資金單日買超人民幣 104.86 億元，已連續 6 個交易日買超，合計金額達人民幣 257.33 億元。香港財政司司長陳茂波出面喊話指出，「港版國安法」不影響資金自由進出及聯繫匯率制度。目前香港的外匯存底相當充裕，再加上有中國作後盾，港元不會出問題。他也向業界保證香港國際金融中心地位不會受到任何影響。
- 財新公布中國 5 月份製造業 PMI 為 50.7，重回擴張區間，且優於預期的 49.6。數據走勢與中國官方公布的並不一致，中國官方 5 月份製造業 PMI 較前一個月下滑 0.2 至 50.6，遜於預期的 51.1。財新指出中國經濟已處於後疫情時期，隨著企業營運逐步恢復正常，製造業生產連續三個月出現回升，不過受外在需求疲弱的影響，新訂單指數仍處於衰退區間，目前生產恢復速度明顯大於市場需求。
- 澳股上漲 1.10%。韓股上漲 1.75%，連 2 日上漲，累積漲幅 1.80%。

債市
與匯市

美國公債價格下跌 美元指數下跌

- 美國 10 年期公債殖利率上漲 0.65 個基點，至 0.659%，公債價格下跌；美國高收益債上漲 0.294%。
- 美元指數下跌 0.52%至 97.83；歐元升值 0.32%至 1.114；日圓升值 0.22%至 107.59；澳幣升值 1.96%至 0.680；南非幣升值 1.03%至 17.368。

油市
與貴金屬

原油價格下跌 黃金價格上漲

- 原油價格下跌 0.14%至 35.440 元。
- 黃金價格上漲 0.54%至 1739.55 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 | 2163.93 | 0.75 | 2.35 | 7.94 | -2.19 | -4.94 | -8.25 | 5.75 | 2020/6/1 |
| S&P 500 | 3055.73 | 0.38 | 3.39 | 7.95 | -1.12 | -1.87 | -5.42 | 11.03 | 2020/6/1 |
| 道瓊工業 | 25475.02 | 0.36 | 4.13 | 7.38 | -4.60 | -8.31 | -10.73 | 2.66 | 2020/6/1 |
| 那斯達克 | 9552.05 | 0.66 | 2.44 | 11.01 | 6.70 | 11.49 | 6.46 | 28.16 | 2020/6/1 |
| VIX指數 | 28.23 | 2.62 | 0.25 | -24.09 | -15.53 | 89.34 | 104.86 | 50.88 | 2020/6/1 |
| 加拿大TSX綜合 | 15236.21 | 0.29 | 1.07 | 4.21 | -7.96 | -10.28 | -10.71 | -5.00 | 2020/6/1 |
| 道瓊歐洲600 | 354.20 | 1.10 | 2.61 | 4.98 | -5.79 | -11.67 | -14.82 | -4.03 | 2020/6/1 |
| 英國富時 | 6166.42 | 1.48 | 2.89 | 7.00 | -7.34 | -15.37 | -18.24 | -13.90 | 2020/6/1 |
| 德國DAX | 11586.85 | -1.65 | 4.63 | 6.68 | -2.55 | -12.46 | -12.55 | -1.19 | 2020/5/29 |
| 法國巴黎 | 4762.78 | 1.43 | 4.91 | 4.17 | -10.70 | -17.69 | -20.33 | -8.54 | 2020/6/1 |
| 日經225 | 22062.39 | 0.84 | 6.37 | 12.45 | 3.37 | -6.24 | -6.74 | 7.09 | 2020/6/1 |
| 東證一部指數 | 1568.75 | 0.32 | 4.43 | 9.61 | 2.81 | -8.50 | -8.87 | 3.73 | 2020/6/1 |
| 澳洲 | 5819.15 | 1.10 | 3.62 | 10.93 | -8.96 | -15.20 | -12.94 | -9.03 | 2020/6/1 |
| 新興市場股市指數 | | | | | | | | | |
| 新興市場指數 | 951.48 | 2.27 | 2.68 | 3.79 | -6.45 | -8.53 | -14.64 | -4.66 | 2020/6/1 |
| 新興亞洲指數 | 513.39 | 2.20 | 2.87 | 2.43 | -3.32 | -3.18 | -9.31 | 3.02 | 2020/6/1 |
| 新興拉美指數 | 1,821.32 | 2.64 | 4.90 | 11.10 | -26.57 | -31.61 | -37.58 | -32.13 | 2020/6/1 |
| 歐非中東指數 | 205.25 | 2.47 | 1.37 | 7.67 | -8.11 | -17.66 | -23.29 | -19.09 | 2020/6/1 |
| 香港恆生 | 23,732.52 | 3.36 | 3.40 | -3.70 | -9.73 | -10.26 | -15.81 | -11.78 | 2020/6/1 |
| 香港國企 | 9,833.83 | 2.85 | 3.89 | -2.06 | -6.21 | -5.11 | -11.95 | -5.33 | 2020/6/1 |
| 滬深300指數 | 3,971.34 | 2.70 | 3.71 | 1.50 | -2.42 | 3.53 | -3.06 | 9.41 | 2020/6/1 |
| 台灣加權 | 11,079.02 | 1.25 | 1.91 | 0.79 | -0.82 | -3.68 | -7.65 | 5.53 | 2020/6/1 |
| 韓國KOSPI | 2,065.08 | 1.75 | 1.74 | 6.03 | 3.12 | -1.28 | -6.03 | 1.14 | 2020/6/1 |
| 印度SENSEX | 33,303.52 | 2.71 | 8.58 | -1.23 | -12.69 | -18.38 | -19.27 | -16.14 | 2020/6/1 |
| 馬來西亞 | 1,490.14 | 1.15 | 2.62 | 5.85 | 1.58 | -5.12 | -6.21 | -9.73 | 2020/6/1 |
| 泰國SET | 1,352.37 | 0.71 | 2.38 | 3.90 | 1.25 | -13.84 | -14.40 | -16.53 | 2020/6/1 |
| 印尼雅加達綜合 | 4,753.61 | 0.79 | 4.51 | 0.79 | -12.82 | -20.93 | -24.54 | -23.44 | 2020/5/29 |
| 菲律賓綜合股價 | 5,930.17 | 1.56 | 7.06 | 4.03 | -12.14 | -24.72 | -24.12 | -25.59 | 2020/6/1 |
| 俄羅斯RTS | 1,247.61 | 2.28 | 2.82 | 10.90 | -4.29 | -12.93 | -19.45 | -3.07 | 2020/6/1 |
| 南非40指數 | 46,950.12 | 0.87 | 1.29 | 1.30 | 0.65 | -3.41 | -7.61 | -5.32 | 2020/6/1 |
| 巴西聖保羅 | 88,620.10 | 1.39 | 3.45 | 10.08 | -16.89 | -18.64 | -23.37 | -8.67 | 2020/6/1 |
| 墨西哥Bolsa | 36,980.84 | 2.38 | 3.20 | 1.40 | -12.30 | -13.08 | -15.07 | -13.49 | 2020/6/1 |
| 匯市與油金 | | | | | | | | | |
| 美元指數 | 97.830 | -0.52 | -2.04 | -1.26 | -0.31 | -0.45 | 1.49 | 0.08 | 2020/6/1 |
| 歐元兌美元 | 1.114 | 0.32 | 1.34 | 2.04 | -0.04 | 0.45 | -0.75 | -1.00 | 2020/6/1 |
| 美元兌日圓 | 107.590 | 0.22 | -0.01 | -0.75 | 0.73 | 1.33 | 0.99 | 0.48 | 2020/6/1 |
| 澳幣兌美元 | 0.680 | 1.96 | 2.09 | 5.66 | 3.90 | -0.40 | -3.26 | -2.65 | 2020/6/1 |
| 美元兌境外人民幣 | 7.127 | 0.09 | 0.21 | 0.02 | -2.33 | -1.20 | -2.35 | -2.91 | 2020/6/1 |
| 美元兌台幣 | 29.933 | 0.28 | 0.42 | -0.66 | 0.54 | 1.91 | 0.19 | 5.19 | 2020/6/1 |
| 美元兌巴西里爾 | 5.365 | -0.52 | 1.50 | 2.25 | -16.58 | -21.40 | -24.98 | -27.56 | 2020/6/1 |
| 美元兌南非蘭德 | 17.368 | 1.03 | 0.08 | 6.90 | -11.55 | -16.35 | -19.48 | -16.88 | 2020/6/1 |
| 西德州原油 | 35.440 | -0.14 | 3.14 | 58.95 | -24.84 | -34.99 | -39.82 | -32.40 | 2020/6/1 |
| 黃金現貨 | 1,739.55 | 0.54 | 1.91 | 2.52 | 9.68 | 19.20 | 14.90 | 33.53 | 2020/6/1 |
| 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 | 0.156 | -0.390 | -1.12 | -3.36 | -75.66 | -145.55 | -141.27 | -176.57 | 2020/6/1 |
| 美國10年期公債 | 0.659 | 0.650 | 0.00 | 4.73 | -48.95 | -111.67 | -125.84 | -146.55 | 2020/6/1 |
| 美國30年期公債 | 1.451 | 4.420 | 8.01 | 20.20 | -22.46 | -75.48 | -93.90 | -111.79 | 2020/6/1 |
| 德國2年期公債 | -0.653 | 0.600 | 2.50 | 10.70 | 11.60 | -2.60 | -5.20 | 0.60 | 2020/6/1 |
| 德國10年期公債 | -0.402 | 4.500 | 9.20 | 18.40 | 20.50 | -4.20 | -21.70 | -20.00 | 2020/6/1 |
| 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 | -0.186 | -0.186 | -0.09 | 8.70 | 11.46 | 5.59 | 4.06 | 3.66 | 2020/6/1 |
| 美國MBS | 0.000 | 0.000 | 0.94 | 3.75 | 6.83 | 4.00 | 3.20 | 3.20 | 2020/6/1 |
| 美國投資級公司債 | -0.040 | -0.040 | 7.07 | 2.73 | 9.56 | 5.66 | 5.04 | 5.47 | 2020/6/1 |
| 新興市場本地債 | 0.009 | 0.009 | 4.81 | 3.45 | 11.00 | 5.59 | 4.37 | 3.61 | 2020/6/1 |
| 新興市場美元債 | 0.335 | 0.335 | 9.49 | -5.86 | 1.17 | 2.51 | 4.20 | 5.87 | 2020/6/1 |
| 美國高收益債 | 0.294 | 0.294 | 8.87 | -5.42 | 0.64 | 2.71 | 4.12 | 6.56 | 2020/6/1 |
| 歐洲高收益債 | 0.309 | 0.309 | 9.77 | -5.70 | 1.56 | 3.77 | 4.70 | 7.65 | 2020/6/1 |

富盛證券投資顧問股份有限公司 (102)金管投顧新字 019 號。臺北總公司：臺北市信義區松德路 171 號 9 樓；(02)2728-3222。台中分公司：台中市市政北一路 77 號 14 樓之 11；(04)2251-3477。台南分公司：台南市林森路 1 段 395 號 9 樓之 6；(06)236-5208。本報告所載係根據各項市場資訊加以整理匯集及研究分析，僅供參考，本公司不保證其正確性及完整性。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，本公司不負任何法律責任。非經本公司同意，不得將本報告內容之一部或全部加以複製、轉載或散佈。本文所提及之個股，僅供舉例之用，不代表本基金之必然持股，亦不代表任何金融商品之推介或建議。富盛證券投顧為先機環球系列基金台灣總代理【富盛證券投顧獨立經營管理】