

富盛投資日報

CG Investments Daily Report

2024 年 5 月 30 日

市場回顧

美國股市

美股下跌 Fed 褐皮書顯示企業對未來悲觀

- 標普 500 指數下跌 0.74%，終止連 2 日上漲；那斯達克指數下跌 0.58%，終止連 2 日上漲。
- 美國聯準會 (Fed) 周三發布的褐皮書顯示，美國經濟活動從 4 月初至 5 月中旬持續擴張，但企業對未來展望的悲觀情緒升溫，與此同時通膨也在溫和成長。報告提到：「零售支出持平或略有上升，反映消費者可自由支配支出的減少和對物價敏感度提高。在不確定性上升和下行風險加大的報告中，整體前景變得更加悲觀。」Fed 調查還顯示，就業市場持續降溫。數據顯示，美國 4 月就業增速創 6 個月來新低，而且薪資年增幅近 3 年來首次降至 4% 以下，然而就業市場仍然吃緊。先前數據顯示美國 4 月進口價格創兩年來最大增幅，原因是能源成本上升，而且 5 月製造業數據顯示一連串投入價格飆升，暗示未來幾個月商品通膨可能升溫。

歐日股市

歐、日股下跌 德通膨意外升溫但預期不影響 ECB 降息

- 道瓊歐洲 600 指數下跌 1.08%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.68%。
- 德國周三最新公布數據顯示通膨意外加速升溫。有經濟學家認為，德國通膨率上升是預料之中，可能不會引起 ECB 決策者的警覺。具體來看，德國 5 月調和消費者物價指數 (HICP) 年增 2.8%，高於市場預期的 2.7%，較前值 2.4% 大幅攀升；按月來看成長 0.2%，符合市場預期，也較前值 0.6% 大幅放緩。外界普遍預估 ECB 將於 6/6 的貨幣政策進行首輪降息，經濟學家也表示，調和通膨連續第二個月上升，沒有理由感到恐慌。他們指出，5 月的數據在很大程度上是意料之中的，部分原因是全國廉價火車票計畫結束所造成的一次性影響。
- 東證指數下跌 0.97%，終止連 2 日上漲；日經指數下跌 0.77%，連 2 日下跌，累計跌幅 0.88%。

新興市場與亞太股市

新興市場、港股下跌 陸股上漲

- MSCI 新興市場指數下跌 1.46%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.67%；新興亞洲下跌 1.58%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.70%；歐非中東下跌 0.61%，連 6 日下跌，累計跌幅 4.12%；拉丁美洲下跌 1.57%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.88%。
- 恆生指數下跌 1.83%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.86%；國企指數下跌 1.92%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.95%；滬深 300 指數上漲 0.12%。
- 澳股下跌 1.30%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.58%。
- 韓股下跌 1.67%，連 2 日下跌，累計跌幅 1.68%。

債市與匯市

美國公債價格下跌 美元指數上漲 美債需求疲軟

- 美國 10 年期公債殖利率上漲 6.17 個基點至 4.612%，公債價格下跌。美國非投資等級債下跌 0.308%。
- 美國財政部週三標售 440 億美元的 7 年期公債，得標殖利率比發行前交易水準上升 1.3 個基點，顯示需求疲軟。這是本週第三次公債拍賣，引發市場質疑，美國財政部週二出售的 2 年期和 5 年期美公債總額近 1,400 億美元，也沒有得到良好的市場反應，導致週二 10 年期和 30 年期美債殖利率達到 5 月 2 日以來最高水平。
- 美元指數上漲 0.49% 至 105.122；歐元貶值 0.52% 至 1.0801；日圓貶值 0.30% 至 157.64；澳幣貶值 0.60% 至 0.6610；南非幣貶值 0.65% 至 18.40。

油市與貴金屬

原油、黃金價格下跌

- 原油價格下跌 0.75% 至 79.23 元。
- 黃金價格下跌 0.98% 至 2338.12 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 | 3430.01 | -1.00 | -0.48 | 3.77 | 2.78 | 13.44 | 8.23 | 21.39 | 2024/5/29 |
| S&P 500 | 5266.95 | -0.74 | -1.02 | 2.95 | 3.35 | 15.74 | 10.42 | 25.24 | 2024/5/29 |
| 道瓊工業 | 38441.54 | -1.06 | -3.59 | 0.14 | -1.42 | 8.50 | 2.00 | 16.16 | 2024/5/29 |
| 那斯達克 | 16920.58 | -0.58 | 0.52 | 5.87 | 5.15 | 18.67 | 12.72 | 30.40 | 2024/5/29 |
| VIX指數 | 14.28 | 10.53 | 20.40 | -2.66 | 6.57 | 10.02 | 14.70 | -20.45 | 2024/5/29 |
| 加拿大TSX綜合 | 21897.98 | -1.65 | -2.01 | -0.52 | 2.50 | 8.86 | 4.48 | 9.67 | 2024/5/29 |
| 道瓊歐洲600 | 513.45 | -1.08 | -1.48 | 1.70 | 3.81 | 11.23 | 7.19 | 12.44 | 2024/5/29 |
| 英國富時 | 8183.07 | -0.86 | -2.77 | 0.48 | 7.25 | 9.78 | 5.82 | 8.79 | 2024/5/29 |
| 德國DAX | 18473.29 | -1.10 | -1.11 | 3.02 | 4.50 | 13.92 | 10.28 | 16.12 | 2024/5/29 |
| 法國巴黎 | 7935.03 | -1.52 | -1.94 | -0.62 | 0.10 | 8.54 | 5.19 | 10.06 | 2024/5/29 |
| 日經225 | 38556.87 | -0.77 | -1.40 | 0.39 | -1.56 | 15.14 | 15.22 | 23.07 | 2024/5/29 |
| 東證一部指數 | 2741.62 | -0.97 | -0.48 | -0.06 | 2.46 | 15.44 | 15.86 | 26.97 | 2024/5/29 |
| 澳洲 | 7665.63 | -1.30 | -2.58 | -0.70 | -1.15 | 7.38 | 0.26 | 5.56 | 2024/5/29 |
| 新興市場股市指數 | | | | | | | | | |
| 新興市場指數 | 1,072.11 | -1.46 | -1.76 | 2.50 | 5.01 | 8.61 | 4.73 | 10.49 | 2024/5/29 |
| 新興亞洲指數 | 584.42 | -1.58 | -1.68 | 3.65 | 7.48 | 11.03 | 7.71 | 11.55 | 2024/5/29 |
| 新興拉美指數 | 2,363.72 | -1.57 | -3.11 | -2.82 | -6.23 | -4.36 | -11.23 | 5.42 | 2024/5/29 |
| 歐非中東指數 | 197.45 | -0.61 | -1.97 | -1.22 | -2.19 | 2.98 | -1.65 | 7.00 | 2024/5/29 |
| 香港恆生 | 18,477.01 | -1.83 | -3.74 | 4.02 | 11.90 | 8.41 | 8.39 | -0.64 | 2024/5/29 |
| 香港國企 | 6,557.48 | -1.92 | -3.82 | 4.52 | 15.49 | 11.95 | 13.68 | 4.36 | 2024/5/29 |
| 滬深300指數 | 3,613.52 | 0.12 | -1.93 | 0.25 | 2.77 | 3.36 | 5.32 | -5.84 | 2024/5/29 |
| 台灣加權 | 21,662.50 | -0.90 | 0.51 | 6.21 | 14.21 | 24.26 | 20.81 | 30.32 | 2024/5/29 |
| 韓國KOSPI | 2,677.30 | -1.67 | -2.19 | -1.11 | 0.75 | 5.00 | 0.26 | 2.96 | 2024/5/29 |
| 印度SENSEX | 74,502.90 | -0.89 | 0.38 | 0.03 | 2.76 | 11.22 | 3.13 | 18.32 | 2024/5/29 |
| 馬來西亞 | 1,605.35 | -0.65 | -1.03 | 1.86 | 3.47 | 10.50 | 10.36 | 14.92 | 2024/5/29 |
| 泰國SET | 1,349.83 | -0.94 | -1.53 | -1.32 | -1.52 | -2.20 | -4.66 | -12.05 | 2024/5/29 |
| 印尼雅加達綜合 | 7,140.23 | -1.56 | -1.74 | -1.30 | -2.40 | 0.84 | -1.82 | 7.59 | 2024/5/29 |
| 菲律賓綜合股價 | 6,411.41 | -1.38 | -2.96 | -4.31 | -7.68 | 3.02 | -0.60 | -1.52 | 2024/5/29 |
| 俄羅斯RTS | 1,167.72 | -0.60 | -2.98 | -0.59 | 3.58 | 4.73 | 7.77 | 11.47 | 2024/5/29 |
| 南非40指數 | 72,189.63 | -0.51 | -1.70 | 2.56 | 8.80 | 4.16 | 2.40 | 1.04 | 2024/5/28 |
| 巴西聖保羅 | 122,707.30 | -0.87 | -2.34 | -3.65 | -4.89 | -2.74 | -8.55 | 11.22 | 2024/5/29 |
| 墨西哥Bolsa | 55,212.64 | 0.05 | -2.16 | -4.52 | -0.36 | 4.58 | -3.79 | 1.84 | 2024/5/29 |
| 匯市與油金 | | | | | | | | | |
| 美元指數 | 105.1220 | 0.49 | 0.20 | -1.01 | 0.95 | 1.59 | 3.76 | 0.94 | 2024/5/29 |
| 歐元兌美元 | 1.0801 | -0.52 | -0.16 | 1.24 | -0.06 | -0.83 | -2.18 | 0.59 | 2024/5/29 |
| 美元兌日圓 | 157.64 | -0.30 | -0.36 | 0.19 | -4.77 | -5.90 | -10.45 | -11.24 | 2024/5/29 |
| 澳幣兌美元 | 0.6610 | -0.60 | 0.05 | 2.10 | 1.72 | 0.06 | -2.98 | 1.41 | 2024/5/29 |
| 美元兌境外人民幣 | 7.27 | -0.14 | -0.20 | -0.24 | -0.88 | -1.73 | -2.01 | -2.49 | 2024/5/29 |
| 美元兌台幣 | 32.31 | -0.44 | -0.12 | 0.80 | -2.20 | -3.46 | -5.37 | -5.20 | 2024/5/29 |
| 美元兌巴西里爾 | 5.20 | -0.64 | -1.03 | -1.63 | -4.50 | -5.75 | -6.77 | -3.60 | 2024/5/29 |
| 美元兌南非蘭德 | 18.40 | -0.65 | 0.08 | 1.72 | 4.01 | 2.11 | -0.55 | 6.68 | 2024/5/29 |
| 西德州原油 | 79.23 | -0.75 | 2.08 | -2.58 | 3.94 | 5.29 | 10.02 | 18.75 | 2024/5/29 |
| 黃金現貨 | 2,338.12 | -0.98 | 0.33 | 2.22 | 14.32 | 14.76 | 13.28 | 19.27 | 2024/5/29 |
| 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 | 4.973 | -0.380 | 3.94 | -6.04 | 35.60 | 29.45 | 72.48 | 52.46 | 2024/5/29 |
| 美國10年期公債 | 4.612 | 6.170 | 13.90 | -6.41 | 36.55 | 28.93 | 73.66 | 92.91 | 2024/5/29 |
| 美國30年期公債 | 4.733 | 6.700 | 15.72 | -4.51 | 35.99 | 24.56 | 71.06 | 84.84 | 2024/5/29 |
| 德國2年期公債 | 3.101 | 4.100 | 9.30 | 13.90 | 20.00 | 26.50 | 69.70 | 22.10 | 2024/5/29 |
| 德國10年期公債 | 2.690 | 9.800 | 15.60 | 15.80 | 27.90 | 25.80 | 66.60 | 25.60 | 2024/5/29 |
| 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 | -0.382 | 0.745 | -1.64 | -2.56 | -0.05 | -3.71 | -0.78 | 0.74 | 2024/5/29 |
| 美國MBS | -0.387 | 1.230 | -1.75 | -2.80 | 1.42 | -3.59 | -0.91 | 0.72 | 2024/5/29 |
| 美國投資級公司債 | -0.402 | 1.030 | -1.32 | -1.40 | 4.98 | -2.74 | 1.06 | 2.26 | 2024/5/29 |
| 新興市場企業債 | -0.260 | 1.320 | 0.12 | 1.64 | 7.77 | -2.35 | 1.05 | 2.60 | 2024/5/29 |
| 新興市場美元債 | -0.357 | 1.279 | -0.32 | 1.72 | 12.33 | -2.08 | 1.23 | 2.70 | 2024/5/29 |
| 美國非投資等級債 | -0.308 | 0.843 | -0.17 | 1.34 | 11.18 | 1.69 | 3.91 | 4.18 | 2024/5/29 |
| 歐洲非投資等級債 | -0.073 | 1.099 | 1.19 | 3.22 | 12.96 | 2.83 | 4.59 | 5.01 | 2024/5/29 |

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。富盛證券投顧為安盛投資管理及先機環球基金總代理【富盛證券投顧獨立經營管理】