

**Market News**

**2016/12/09**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.752 | 31.829 | 31.699 |
| USD/CNY | 6.8767 | 6.891 | 6.8706 |
| USD/CNH | 6.9124 | 6.9165 | 6.8873 |
| USD/JPY | 114.04 | 114.38 | 113.13 |
| EUR/USD | 1.0615 | 1.0874 | 1.0598 |
| AUD/USD | 0.7463 | 0.7508 | 0.7429 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65811 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.9213 | 0.2727 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 4.9373 | 0.1166 |
| TW IRS 3Y | | 0.8905 | -0.0001 |
| TW IRS 5Y | | 1.1125 | 0.0125 |
| TW 5Y BOND | | 0.8145 | -0.0106 |
| TW 10Y BOND | | 1.0925 | 0.0225 |
| SHIBOR O/N | | 2.2908 | -0.0012 |
| SHIBOR 1M | | 3.03 | 0.0304 |
| SHIBOR 3M | | 3.1144 | 0.001 |
| CN 7Y BOND | | 3.073 | -0.014 |
| CN 10Y BOND | | 3.092 | 0 |
| USD LIBOR O/N | | 0.43367 | -0.00055 |
| USD LIBOR 3M | | 0.95083 | 0 |
| USD 10Y BOND | | 2.4071 | 0.0815 |
| USD 30Y BOND | | 3.1053 | 0.0962 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 53 | 0.89 |
| WTI | | 50.84 | 0.19 |
| GOLD | | 1170.78 | -2.6 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19614.81 | 65.19 |
| Nasdaq | | 5417.356 | 23.594 |
| S&P 500 | | 2246.19 | 4.84 |
| DAX | | 11179.42 | 192.73 |
| SSEA | | 3373.922 | -7.217 |
| HIS | | 22800.92 | 60.92 |
| TAIEX | | 9375.86 | 2.69 |
| Nikkei 225 | | 18765.47 | 90.28 |
| KOSPI | | 2031.07 | -4.99 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 歐洲央行周四宣布，將從明年4月起將月度購債規模從目前的800億歐元削減至600億，但把購債計劃的原定結束期限從2017年3月延長至明年底，較市場預期多了三個月，以扶助仍然脆弱的經濟復甦。央行還否認了將逐步撤走刺激計劃的傳言。
* 美國勞工部報告，截至12月3日當周，初請失業金人數減少1萬人，經季節性調整後為25.8萬。這是初請失業金人數連續第92周處於30萬大關之下，反應就業市場狀況強勁，持續時間為1970年以來最長，可能推動美聯儲在下周升息。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週四收升逾1角，至近一個月高位。韓元等亞幣走強，且台股大漲，外資大幅匯入，使台幣連續三日收升。上日美股大漲，部分被動式基金勢必回頭亞股再投資，因此今日臺灣股、匯雙漲，外資又回頭追捧下，使得台幣告別32大關，甚至一度升破31.7關卡；不過另一方面則有油款及進口商買匯，今日量雖放大，但並非爆量。若從國際美元走向來看，美聯儲下周升息已是勢在必行，但臺灣央行年底預料仍將維持利率不變，由利差擴大的角度來看，美元相對台幣預料仍有走強契機。今日台幣兌美元區間暫看31.750-31.900。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率昨日持穩在高位。市場資金較為寬鬆，多家大型公股銀行均可拆出，惟此前連續上揚兩天的拆款利率則不見下滑。人民幣市場方面，隔拆利率在2.8%-3.25% 一年DF 價格在2115-2250。

**債券市場**

週四美國無重要數據公佈，但ECB會議決定延長量化寬鬆時間與減少每月收購資產的規模，該每月縮減規模的消息令市場利率彈升，終場10年期美債利率上揚6.7bps收2.407%；30年期利率上揚8.3bps收3.105%，今日市場關注美國密西根大學消費信心指數公佈，預估於下週利率決策會議前美債利率將維持高檔震盪。

**期貨市場**

週四離岸人民幣續貶。亞洲盤持穩在6.8930附近，晚間ECB意外縮減資產購買規模但延長刺激計畫至明年底，提振美元走強，非美貨幣走弱，人民幣急貶至6.91，最低貶至6.9161。離岸人民幣換匯點一個月290(+8)，一年2195(+30)。期貨週四成交2537口，成交約當金額0.76億美金，留倉口數4163口，約當留倉金額1.38億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 12/08 | CH | 貿易收支(人民幣) | Nov | 320.00b | 298.11b | 325.25b |
| 12/08 | CH | 出口(年比)人民幣 | Nov | -1.00% | 5.90% | -3.20% |
| 12/08 | CH | 進口(年比)人民幣 | Nov | 3.60% | 13.00% | 3.20% |
| 12/08 | CH | 貿易收支 | Nov | $46.90b | $44.61b | $49.06b |
| 12/08 | CH | 出口(年比) | Nov | -5.00% | 0.10% | -7.30% |
| 12/08 | CH | 進口(年比) | Nov | -1.90% | 6.70% | -1.40% |
| 12/08 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 3-Dec | 255k | 258k | 268k |
| 12/08 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 26-Nov | 2048k | 2005k | 2081k |
| 12/09 | CH | CPI(年比) | Nov | 2.20% | -- | 2.10% |
| 12/09 | CH | PPI(年比) | Nov | 2.30% | -- | 1.20% |
| 12/09 | US | 密西根大學市場氣氛 | Dec P | 94.5 | -- | 93.8 |
| 12/09-12/18 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Nov | 2.00% | -- | -- |

**免責聲明**

* **本研究報告僅供本公司特定客戶參考。**
* **客戶進行投資決策時，應審慎考量本身之需求、投資風險及風險承壓度，並就投資結果自行負責，本公司不作任何獲利保證，亦不就投資損害負任何法律責任。**
* **本研究報告內容取材自本公司認可之來源，但不保證其完整性及精確性、該報告所載財務資料、預估及意見，係本公司於特定日期就現有資訊所作之專業判斷，嗣後變更時，本公司將不做預告或更新；本研究報告內容僅供參考，未盡完善之處，本公司恕不負責。除經本公司同意，不得將本研究報告內容複製、轉載或以其他方式提供予其他第三人。**