

**Market News**

**2016/12/21**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 32.005 | 32.005 | 31.963 |
| USD/CNY | 6.9605 | 6.9575 | 6.9481 |
| USD/CNH | 6.939 | 6.9539 | 6.93 |
| USD/JPY | 117.86 | 118.24 | 116.99 |
| EUR/USD | 1.0388 | 1.0418 | 1.0352 |
| AUD/USD | 0.7259 | 0.7263 | 0.7223 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0 |
| TAIBOR 3M | | 0.65911 | 0.001 |
| CNT TAIBOR 3M | | 8.9069 | 0.4602 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 6.5192 | 0.3009 |
| TW IRS 3Y | | 0.9554 | 0.0064 |
| TW IRS 5Y | | 1.205 | 0.0125 |
| TW 5Y BOND | | 0.845 | 0.0305 |
| TW 10Y BOND | | 1.181 | -0.004 |
| SHIBOR O/N | | 2.345 | 0.01 |
| SHIBOR 1M | | 3.2 | 0.0305 |
| SHIBOR 3M | | 3.204 | 0.0142 |
| CN 7Y BOND | | 3.305 | -0.013 |
| CN 10Y BOND | | 3.42 | 0.042 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68111 | -0.00278 |
| USD LIBOR 3M | | 0.99428 | -0.00305 |
| USD 10Y BOND | | 2.5586 | 0.0333 |
| USD 30Y BOND | | 3.1396 | 0.0368 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.35 | 0.23 |
| WTI | | 53.3 | 0.27 |
| GOLD | | 1132.35 | -1.12 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19974.62 | 91.56 |
| Nasdaq | | 5483.944 | 26.503 |
| S&P 500 | | 2270.76 | 8.23 |
| DAX | | 11464.74 | 38.04 |
| SSEA | | 3264.674 | -15.89 |
| HIS | | 21832.68 | -103.62 |
| TAIEX | | 9242.41 | -8.38 |
| Nikkei 225 | | 19494.53 | 82.08 |
| KOSPI | | 2041.94 | 5.06 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 中國央行副行長、國家外匯管理局局長潘功勝表示，目前跨境資本流動風險可控，支撐國際收支平衡的根本性因素仍然長期存在。外管局網站援引他的談話稱，外匯局將在堅持現有政策框架不變的基礎上，促進貿易投資便利化。
* 英國首相特雷莎·梅將在2017年初提出更多退歐策略綱要。她表示，明年初將提出更多的英國退出歐盟綱要，強調政府不打算只是複製現有歐盟會員資格中的部分待遇，而是要打造與歐盟的新關係。她在答覆議員問題時，重申希望能爭取到最好的協議。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週二微收跌，並錄得連四日跌勢，尾盤貶破32元整數大關，創逾一個月新低。由於美聯儲主席葉倫演講提及目前美國就業市場情況為將近10年來最好，支撐國際美元續強令韓元等亞幣走勢疲軟，台幣暫且消化年底出口商拋匯賣需，令台幣貶幅有限、跌勢較為緩和。除葉倫談話推升美元外，德國及土耳其等地發生攻擊事件也提振美元避險需求，帶動台幣隨韓元等亞幣再探新低，不過年底出口商拋匯賣需仍在，明顯緩解台幣跌勢不若韓元等主要亞幣。預計今日台幣兌美元區間將在31.950-32.050。

**貨幣市場**

臺灣銀行間年內短率周二大致持穩，跨月利率略走高。市場資金充裕，多家大型銀行已陸續提供跨月拆借；但在利率方面，對票券商14天期拆在0.56-0.57%，對銀行則介於0.42-0.50%。人民幣市場方面，隔拆利率在8.00%-12.00%，一年天期cnh swap落在 2,950 -3,320。

**債券市場**

週二美國無重要數據公布，受到股市上漲激勵，資金湧向股市反帶動債券市場利率小幅反彈，惟目前高檔震盪走勢不變，終場10年期美債利率小幅上揚2.0bps收2.559%；30年期利率小幅彈升1.7bps收3.140%，今日市場關注美國11月成屋銷售數據公佈，短線市場預估仍維持高檔震盪。

**期貨市場**

週二離岸人民幣回吐前一天升幅，從6.93貶至最低6.9540，歐美盤回到6.935附近。離岸人民幣換匯點則是大幅回跌，一個月530(-58)，一年3130(-225)，一年期自最高3400回到3000，年底前估計人民幣再大幅走貶機率降低。期貨週二成交3235口，成交約當金額1.13億美金，留倉口數5131口，約當留倉金額1.73億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 12/20 | CH | Swift全球支付人民幣 | Nov | -- | 2.00% | 1.67% |
| 12/20 | TA | 出口訂單(年比) | Nov | 5.00% | 7.00% | 0.30% |
| 12/21 | US | MBA 貸款申請指數 | 16-Dec | -- | -- | -4.00% |
| 12/21 | US | 成屋銷售 | Nov | 5.50m | -- | 5.60m |
| 12/21 | US | 成屋銷售 (月比) | Nov | -1.80% | -- | 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。**