

**Market News**

**2016/12/30**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 32.312 | 32.35 | 32.27 |
| USD/CNY | 6.9613 | 6.9566 | 6.9498 |
| USD/CNH | 6.964 | 6.9873 | 6.9637 |
| USD/JPY | 116.54 | 117.26 | 116.23 |
| EUR/USD | 1.049 | 1.0494 | 1.0409 |
| AUD/USD | 0.7219 | 0.7223 | 0.717 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0.02 |
| TAIBOR 3M | | 0.65922 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 8.882 | -0.1313 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 6.4413 | 0.0613 |
| TW IRS 3Y | | 0.9675 | 0 |
| TW IRS 5Y | | 1.235 | 0 |
| TW 5Y BOND | | 0.955 | -0.005 |
| TW 10Y BOND | | 1.241 | -0.0405 |
| SHIBOR O/N | | 2.227 | -0.019 |
| SHIBOR 1M | | 3.2988 | 0.0043 |
| SHIBOR 3M | | 3.2651 | 0.0059 |
| CN 7Y BOND | | 3.14 | -0.037 |
| CN 10Y BOND | | 3.047 | -0.092 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68656 | -0.00722 |
| USD LIBOR 3M | | 0.99817 | 0.00111 |
| USD 10Y BOND | | 2.475 | -0.0385 |
| USD 30Y BOND | | 3.079 | -0.0174 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 56.85 | 0.12 |
| WTI | | 53.77 | 0.18 |
| GOLD | | 1158.19 | 4.76 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19819.78 | -13.9 |
| Nasdaq | | 5432.088 | -6.468 |
| S&P 500 | | 2249.26 | -0.66 |
| DAX | | 11451.05 | -23.94 |
| SSEA | | 3248.144 | -6.478 |
| HIS | | 21754.74 | 36.17 |
| TAIEX | | 9153.09 | 66.06 |
| Nikkei 225 | | 19145.14 | -115.59 |
| KOSPI | | 2024.49 | 1.97 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國上月出口減少導致商品貿易赤字擴大；而上周初請失業金人數減少，是勞動力市場的又一積極信號。當特朗普下月就任美國總統時，勞動力市場可能基本實現充分就業，但國際貿易可能給經濟帶來拖累。美國初請失業金人數減少1萬人，經季節調整後為26.5萬人。這是連續第95周少於30萬人門檻，為1970年以來的最長跨度。
* 中國外匯交易中心(CFETS)周四宣布，明年起CFETS人民幣匯率指數貨幣籃子新增11種貨幣至24種，其中美元權重由0.2640下調至0.2240，以進一步完善CFETS人民幣匯率指數生成發布機制，增強匯率指數貨幣籃子代表性，外匯交易中心的公告顯示，2017年CFETS貨幣籃子新增11個幣種。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週四微收跌續探近半年新低，並錄得連11日貶勢。日圓及韓元等亞幣稍見止跌回升、外資轉偏賣匯及年底暫且消化出口商拋匯賣需，此皆收斂台幣續跌態勢，昨日台幣多在32.300整數關卡附近狹幅盤整。本週五(30日)是今年最後一個交易日，去年12月31日台幣兌美元收報33.066，今年至今台幣仍走升2.33%，表現明顯優於韓元等其他亞幣，預估今日台幣將略有補跌壓力，但隨著美元高位回檔，料續呈區間偏弱整理格局。預計今日成交區間32.150~32.300。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周四續穩中趨跌。年底資金寬裕，票券商幾乎沒有缺口，跨年資金需求低迷，市場氣氛相當冷清。人民幣市場方面，隔拆利率在6-10%，市場清淡，一年天期cnh swap落在 3,280-3,329。

**債券市場**

週四美國公布初請失業金數據大致與市場持平，美股走跌美債利率小幅下滑，終場美債10年期利率下滑3.3bps收2.475%；30年期利率下滑1.4bps收3.079%，今日市場關注芝加哥採購經理人指數，年底前市場交投表現清淡，美債10年券預估將於2.50%上下震盪整理。

**期貨市場**

週四離岸人民幣在亞洲盤時間續貶，最低來到6.9868，為今年新低，惟低檔處可見人民幣空頭回補，6.98之上美元賣壓沉重，終場收6.9652。離岸人民幣換匯點長天期續漲，一個月640(+73)，一年3380(+160)，一年期最高成交3400。期貨週四成交2359口，成交約當金額0.92億美金，留倉口數4705口，約當留倉金額1.44億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 12/29 | US | 進階商品貿易餘額 | Nov | -$61.6b | -$65.3b | -$62.0b |
| 12/29 | US | 躉售存貨(月比) | Nov P | 0.20% | 0.90% | -0.40% |
| 12/29 | US | 零售庫存(月比) | Nov | -- | 1.00% | -0.40% |
| 12/29 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 24-Dec | 265k | 265k | 275k |
| 12/29 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 17-Dec | 2027k | 2102k | 2036k |
| 12/29 | US | 彭博消費者舒適度 | 25-Dec | -- | 46 | 46.7 |
| 12/30 | US | 芝加哥採購經理人指數 | Dec | 56.8 | -- | 57.6 |
| 12/30 | CH | BoP Current Account Balance | 3Q F | -- | -- | $71.2b |

**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。**