

**Market News**

**2017/01/04**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 32.245 | 32.375 | 32.186 |
| USD/CNY | 6.945 | 6.964 | 6.953 |
| USD/CNH | 6.959 | 6.9874 | 6.9569 |
| USD/JPY | 117.75 | 118.6 | 117.22 |
| EUR/USD | 1.0405 | 1.049 | 1.0341 |
| AUD/USD | 0.7219 | 0.7241 | 0.7183 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.16 | -0.05 |
| TAIBOR 3M | | 0.65911 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 9.8087 | 0.5994 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 6.804 | 0.2969 |
| TW IRS 3Y | | 0.9079 | 0 |
| TW IRS 5Y | | 1.145 | 0 |
| TW 5Y BOND | | 0.876 | 0.008 |
| TW 10Y BOND | | 1.1436 | -0.0464 |
| SHIBOR O/N | | 2.209 | -0.021 |
| SHIBOR 1M | | 3.3126 | 0.0067 |
| SHIBOR 3M | | 3.2813 | 0.0087 |
| CN 7Y BOND | | 3.064 | 0.048 |
| CN 10Y BOND | | 3.117 | 0.057 |
| USD LIBOR O/N | | 0.69211 | 0.00389 |
| USD LIBOR 3M | | 0.99789 | 0 |
| USD 10Y BOND | | 2.4444 | 0.0185 |
| USD 30Y BOND | | 3.0462 | -0.0033 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.47 | 0.27 |
| WTI | | 52.33 | 0.29 |
| GOLD | | 1158.84 | -0.64 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19881.76 | 119.16 |
| Nasdaq | | 5429.084 | 45.967 |
| S&P 500 | | 2257.83 | 19 |
| DAX | | 11584.24 | -14.09 |
| SSEA | | 3249.592 | 33.858 |
| HIS | | 22000.56 | 149.84 |
| TAIEX | | 9272.88 | -1.73 |
| Nikkei 225 | | 19114.37 | 344.17 |
| KOSPI | | 2043.97 | 0.72 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國12月製造業活動加速，觸及兩年最高水準，因新訂單與就業指數大幅上揚。其次，11月美國建築也支出觸及10年半高位，可能給第四季成長帶來進一步的提振。供應管理協會(ISM)表示，12月美國製造業活動指數上揚1.5至54.7，為2014年12月以來最高。
* 週二德國公佈資料顯示，12月CPI高於市場預期，觸及近三年最高水準。12月消費者物價調和指數(HICP)初值較上年同比上升1.7%，高於11月的同比上漲0.7%。12月消費者物價指數(CPI)初值較上年同期上升1.7%，亦高於11月的上漲0.8%。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週二早盤先貶後升。受人民幣等亞幣盤初走弱影響，台幣跟著走低，一度刷新近半年盤中新低；惟隨後在外資匯入力道增強及出口商進場拋匯帶動下，促使台幣止貶走升。隨國際美元轉強，早盤人民幣等亞幣盤初均呈偏弱格局，台幣亦一度跟著走低，惟隨後因外資匯入力道明顯轉強而震盪走升，短線觀察重點在外資匯入和出口商拋匯力道及市場預期心理。預計今日成交區間32.150~32.300。

**貨幣市場**

臺灣銀行間短率週二在提存期最後一日略微走低。央行在年關前著手調控市場資金，更有去年發行的1,500億台幣一年期定存單到期，挹注市場，使12月提存期最末日資金非常寬裕，供過於求。人民幣市場方面，隔拆利率在13.00%-17.00%，一年天期cnh swap落在 3,360 -3,570。

**債券市場**

週二美國公布經濟數據表現強勁，12月ISM製造業指數由53.2上揚至54.7高於市場預估53.8，數據強勁帶動美債10年券一度回到2.50%上方，終場利率收於平盤附近，10年期利率收2.444%；30年期利率下滑1.9bps收3.046%，今日市場關注晚間FOMC會議紀要，美債10年券預估有機會回測2.40%。

**期貨市場**

週二離岸人民幣止貶回升，升破6.96。亞洲開盤開6.98之上，不久人民幣空方回補急升，接連升破6.97及6.96關卡，晚間美國12製造業數據優於預期，人民幣收在當日低點6.9581。離岸人民幣換匯點漲多回吐，一個月678(-112)，一年3380(-240)，早盤一年期還在3600之後，不久後迅速回落3400。期貨週二成交664口，成交約當金額0.27億美金，留倉口數4742口，約當留倉金額1.46億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 01/03 | TA | 日經台灣製造業採購經理人指數 | Dec | -- | 56.2 | 54.7 |
| 01/03 | CH | 財新中國製造業採購經理人指數 | Dec | 50.9 | 51.9 | 50.9 |
| 01/03 | US | Markit美國製造業採購經理人指數 | Dec F | 54.2 | 54.3 | 54.2 |
| 01/03 | US | ISM 製造業指數 | Dec | 53.8 | 54.7 | 53.2 |
| 01/03 | US | 營建支出 (月比) | Nov | 0.50% | 0.90% | 0.50% |
| 01/04 | US | MBA 貸款申請指數 | 30-Dec | -- | -- | -- |
| 01/04-01/05 | US | Wards國內車輛銷售 | Dec | 13.70m | -- | 13.85m |
| 01/04-01/05 | US | Wards總車輛銷售 | Dec | 17.70m | -- | 17.75m |

**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。**