

**Market News**

**2017/01/16**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.602 | 31.696 | 31.569 |
| USD/CNY | 6.8941 | 6.9052 | 6.886 |
| USD/CNH | 6.843 | 6.8753 | 6.8279 |
| USD/JPY | 114.49 | 115.45 | 114.01 |
| EUR/USD | 1.0643 | 1.0673 | 1.0596 |
| AUD/USD | 0.7502 | 0.751 | 0.7449 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.16 | -0.02 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0 |
| CNT TAIBOR 3M | | 7.1533 | 0.702 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.9667 | 0.266 |
| TW IRS 3Y | | 0.8685 | -0.0075 |
| TW IRS 5Y | | 1.105 | 0.0025 |
| TW 5Y BOND | | 0.808 | -0.002 |
| TW 10Y BOND | | 1.15 | -0.0155 |
| SHIBOR O/N | | 2.104 | 0.001 |
| SHIBOR 1M | | 3.6718 | 0.0331 |
| SHIBOR 3M | | 3.6874 | 0.0338 |
| CN 7Y BOND | | 3.114 | -0.039 |
| CN 10Y BOND | | 3.199 | 0.007 |
| USD LIBOR O/N | | 0.69278 | 0 |
| USD LIBOR 3M | | 1.02317 | 0.00139 |
| USD 10Y BOND | | 2.3964 | 0.0333 |
| USD 30Y BOND | | 2.9886 | 0.0282 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.45 | 0.16 |
| WTI | | 52.37 | 0.15 |
| GOLD | | 1197.34 | 4.01 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19885.73 | -5.27 |
| Nasdaq | | 5574.116 | 26.629 |
| S&P 500 | | 2274.64 | 4.2 |
| DAX | | 11629.18 | 108.14 |
| SSEA | | 3266.037 | -6.768 |
| HIS | | 22829.02 | 108.36 |
| TAIEX | | 9378.83 | -87.31 |
| Nikkei 225 | | 19287.28 | -115.66 |
| KOSPI | | 2076.79 | -5.96 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 石油輸出國組織(OPEC)秘書長巴爾金都對產油國落實上月達成的減產協議抱持信心。根據協議，OPEC成員國和俄羅斯等非OPEC產油國將減產近180萬桶/日，減產時間初步定為六個月。巴爾金都稱，OPEC沒有特定的油價目標，OPEC決定控制供給，主要是為了解決高庫存問題，而高庫存已經開始下降。
* 美國12月零售銷售增長，因汽車和家具需求旺盛。今年有望以更快的步伐增長。周五公布的另一項數據顯示，上月生產者物價指數(PPI)連續第二個月上漲，創逾兩年來最大同比漲幅，消費者開始預期，未來商品和服務價格將會上漲。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週五放量收升逾1角，創逾兩個月新高。在外資持續大舉匯入，加上韓元和人民幣等亞幣午後勁升帶動下，台幣進一步攻高並連四日收升，本周升幅逾1.2%。美元指數雖略走穩，惟韓元和人民幣等持續往升值方向挺進，台幣在亞幣走揚、外資買超台股並續呈淨匯入，及部分出口商進場拋匯拉抬之下，午後多數時間都在31.600以下交易，尾盤隨進口商進場低接美元，使美元勉強守住31.600以上價位。預計今日成交區間在31.600~31.800。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周五大持穩於近期低位。開始進入農曆春節的資金需求高峰期，儘管目前央行刻意寬鬆市場資金，但仍有銀行偏向保守操作。人民幣市場波動劇烈，隔拆利率在1.50%-8.00%，一年天期cnh swap落在 2,850 -3,100。

**債券市場**

週五美國公布生產者物價、零售銷售與密大消費者信心大致弱於市場預估，但整體美債利率受到消費者通膨預期提升影響，利率小幅彈升，10年期美債利率上揚3.32bps收2.396%；30年期利率上揚2.82bps收2.989%，本週市場關注消費物價、工業生產與新屋開工、許可，數據面預估偏向穩定，短線操作建議暫以區間操作為宜。

**期貨市場**

週五離岸人民幣走升，盤中一度升破6.83，但不久旋即收斂漲勢回到6.84之上。週五美國公布零售數字增長及連續兩個月上漲的PPI，推升美元走強，數據公布後人民幣小幅走貶，最低貶至6.86。離岸人民幣換匯點上漲，一個月480(+75)，一年2970(+110)。期貨週五成交632口，成交約當金額0.21億美金，留倉口數3897口，約當留倉金額1.27億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 01/13 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Dec | 0.80% | 5.70% | -- |
| 01/13 | US | PPI最終需求(年比) | Dec | 1.60% | 1.60% | 1.30% |
| 01/13 | US | PPI(不含食品及能源)(年比) | Dec | 1.50% | 1.60% | 1.60% |
| 01/13 | US | 先期零售銷售(月比) | Dec | 0.70% | 0.60% | 0.10% |
| 01/13 | US | 密西根大學市場氣氛 | Jan P | 98.5 | 98.1 | 98.2 |

**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。**