

**Market News**

**2017/01/19**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.586 | 31.6 | 31.41 |
| USD/CNY | 6.845 | 6.8713 | 6.8315 |
| USD/CNH | 6.8402 | 6.8424 | 6.8006 |
| USD/JPY | 114.65 | 114.76 | 112.57 |
| EUR/USD | 1.063 | 1.0715 | 1.0629 |
| AUD/USD | 0.7505 | 0.7567 | 0.7503 |
| **Interest Rate** | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | 0.21 | 0 |
| TAIBOR 3M | 0.65933 | 0.00022 |
| CNT TAIBOR 3M | 6.638 | -0.1377 |
| CNT TAIBOR 1Y | 5.5787 | -0.1856 |
| TW IRS 3Y | 0.884 | 0.0105 |
| TW IRS 5Y | 1.125 | 0.0125 |
| TW 5Y BOND | 0.8349 | 0.0249 |
| TW 10Y BOND | 1.1635 | -0.0015 |
| SHIBOR O/N | 2.328 | 0.0717 |
| SHIBOR 1M | 3.7502 | 0.0386 |
| SHIBOR 3M | 3.7491 | 0.0269 |
| CN 7Y BOND | 3.149 | 0.042 |
| CN 10Y BOND | 3.268 | 0.003 |
| USD LIBOR O/N | 0.69 | -0.00278 |
| USD LIBOR 3M | 1.02483 | 0.00111 |
| USD 10Y BOND | 2.4296 | 0.0933 |
| USD 30Y BOND | 3.0129 | 0.0674 |
| **Commodity** | **Last** | **Chg** |
| BRENT | 55.47 | -1.55 |
| WTI | 51.08 | 0.35 |
| GOLD | 1204.3 | -0.48 |
| **Stock** | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | 19804.72 | -22.05 |
| Nasdaq | 5555.654 | 16.927 |
| S&P 500 | 2271.89 | 4 |
| DAX | 11599.39 | 59.39 |
| SSEA | 3255.329 | 4.444 |
| HIS | 22840.97 | 257.29 |
| TAIEX | 9341.97 | -30.67 |
| Nikkei 225 | 18894.37 | 201.04 |
| KOSPI | 2070.54 | 0.18 |
| Source: Bloomberg |



* 美聯儲主席葉倫表示，隨著美國經濟接近充分就業、通脹向2%的目標回升，聯儲逐步升息是合理的，等太久才開始向中性利率靠攏，可能會有未來出現不願意看到的意外的風險－要麼通脹太高、要麼金融不穩定，抑或兩者都有。且聯儲官員預計，至2019年美聯儲每年都會升息幾次，令聯邦基金利率接近3%的長期可持續利率水準。
* OPEC暗示2017年石油供應過剩的數量將下降，因該組織成員國石油產量從紀錄高位下滑，非成員國則顯示出遵守減產協議的初步正面跡象，但上調了對美國石油供給增長的預估。

**Market Recap**

**外匯市場**

 台幣兌美元週三微收升，連續第二日上漲。反應美國候任總統特朗普指美元過強的談話，盤初台幣隨非美貨幣一度急彈至逾三個月盤中高位，惟進口商買匯需求湧現及午後外資轉趨匯出皆令台幣升幅收斂，後續觀望國際美元進一步走向指引。昨日交投轉趨熱絡，主要來自進口商在台幣升破31.500買匯意願明顯增強，出口商拋匯交投則較顯冷清，至於外資買賣匯交易皆有，早上偏賣匯、下午轉偏買匯，尤其是午後有外資保管行匯出讓台幣升幅幾乎全數吐回。預計今日成交區間在31.550~31.750。

**貨幣市場**

 台灣銀行間短率周三下滑。市場資金仍是相當寬鬆，已有部分大型銀行下調利率，對銀行跨農曆年拆款利率自0.38-0.40%往下調為0.38-0.39%，對票券商亦自0.42%調降為0.40-0.41%。人民幣市場部分，隔拆利率在1.50%-2.50%，一年天期cnh swap落在 2,400 -2,570。

**債券市場**

 週三美國公佈經濟數據大致表現平穩，美債市場主要受Fed主席耶倫表示經濟正在接近充分就業與物價穩定目標，因此支持漸進升息，其談話帶動美債利率反彈，終場美債10年券利率上揚10.4bps收2.429%；30年券利率上揚8.1bps收3.013%，今日市場關注新屋開工與許可數據，短線關注美債10年券是否站穩2.40%。

**期貨市場**

 週三離岸人民幣匯率亞洲盤維持震盪走勢，震盪區間6.81~6.82，但晚間受耶倫談話偏鷹派影響，國際美元走強，離岸人民幣最終收於6.84附近。離岸人民幣換匯點回升，一個月380(+65)，一年2480(-20)。期貨週三成交679口，成交約當金額0.246億美金，留倉口數3540口，約當留倉金額1.182億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date  | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 01/18 | US | MBA 貸款申請指數 | 13-Jan | -- | 0.80% | 5.80% |
| 01/18 | US | CPI(年比) | Dec | 2.10% | 2.10% | 1.70% |
| 01/18 | US | NAHB 房屋市場指數 | Jan | 69 | 67 | 70 |
| 01/19 | US | 總淨 TIC 流量 | Nov | -- | $23.7b | $18.8b |
| 01/19 | US | 淨長期 TIC 流量 | Nov | -- | $30.8b | $9.4b |
| 01/19 | US | 新屋開工 | Dec | 1188k | -- | 1090k |
| 01/19 | US | 新屋開工(月比) | Dec | 9.00% | -- | -18.70% |
| 01/19 | US | 營建許可 | Dec | 1225k | -- | 1201k |
| 01/19 | US | 建築許可 (月比) | Dec | 1.10% | -- | -4.70% |
| 01/19 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 14-Jan | 252k | -- | 247k |
| 01/19 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 7-Jan | 2075k | -- | 2087k |
| 01/19 | US | 費城聯準企業展望 | Jan | 15.3 | -- | 21.5 |

**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。**