

**Market News**

**2017/01/26**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.332 | 31.395 | 31.306 |
| USD/CNY | 6.859 | 6.8854 | 6.8646 |
| USD/CNH | 6.8282 | 6.8397 | 6.8151 |
| USD/JPY | 113.67 | 113.99 | 113.04 |
| EUR/USD | 1.0738 | 1.077 | 1.0711 |
| AUD/USD | 0.7558 | 0.7599 | 0.7515 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.659 | -0.00022 |
| CNT TAIBOR 3M | | 7.1964 | 0.6378 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.9457 | 0.4171 |
| TW IRS 3Y | | 0.8933 | 0.0091 |
| TW IRS 5Y | | 1.155 | 0.025 |
| TW 5Y BOND | | 0.83 | -0.0065 |
| TW 10Y BOND | | 1.1216 | -0.0534 |
| SHIBOR O/N | | 2.165 | 0.001 |
| SHIBOR 1M | | 3.8295 | 0.0153 |
| SHIBOR 3M | | 3.8551 | 0.015 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.355 | 0.081 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68833 | -0.00056 |
| USD LIBOR 3M | | 1.03178 | -0.00611 |
| USD 10Y BOND | | 2.5116 | 0.052 |
| USD 30Y BOND | | 3.0967 | 0.0561 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.08 | 0.34 |
| WTI | | 52.75 | 0.3 |
| GOLD | | 1197.83 | 2.92 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20068.51 | 155.8 |
| Nasdaq | | 5656.339 | 55.381 |
| S&P 500 | | 2298.37 | 18.3 |
| DAX | | 11806.05 | 211.11 |
| SSEA | | 3290.623 | 7.334 |
| HIS | | 22949.86 | 99.26 |
| TAIEX | | 9424.05 | 23.9 |
| Nikkei 225 | | 19057.5 | 241.47 |
| KOSPI | | 2066.94 | 15.07 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國總統特朗普簽署命令，正在大力推進徹底的隔離計畫，改變美國處理移民和國家安全事務的方式。預計未來數日這位共和黨總統還將採取進一步措施限制非法移民，包括簽署行政命令限制難民，並限制對一些穆斯林為主的中東及北非國家的公民發放簽證。
* 中國央行稱，對於符合規定的人民幣跨境收付，沒有設置額度或比例限制，央行將繼續加強跨境資金流動的宏觀審慎管理。並稱，跨境人民幣業務應始終堅持服務實體經濟，促進貿易投資便利化。此外，近期未出臺嚴格進口貿易融資方面的外匯管理措施，具有真實貿易、投資背景的跨境擔保業務及相關產品不受影響。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週三量縮第四日收升，創近四個月高位。美元指數在100附近偏弱整理，外資持續匯入且出口商在週四封關日前拋匯，使得台幣仍表現偏強。由於台股已于昨日封關，外資在匯完昨日買超台股的交割款後，預料賣匯的力道將有所減輕，明日台幣料隨國際美元浮動。大型公股銀行交易員認為，美元指數近兩日在100上下整理，市場主要觀望美國總統特朗普保護主義的後續發展，將來會進一步走升或貶值仍需觀察。預計今日成交區間在31.300~31.500。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周三再走高。受到部分大型銀行未能提供拆款資金影響，市場資金更趨緊俏，利率進一步走高，大銀行對銀行拆款利率拉升高至0.43%，而對票券商拆出利率則調升為0.45%。人民幣市場部分，隔拆利率在1.50%-2.50%，一年天期cnh swap落在 2,780 -3,050。

**債券市場**

週三美國無重要數據公佈，但美債市場反應道瓊工業指數衝破2萬點影響，帶動債券市場利率向上彈升，終場美債10年券利率上揚4.6bps收2.512%；30年券利率上揚4.8bps收3.097%，今日市場關注美國初請失業數據與新屋銷售，目前美債10年券回測2.40%後再次上揚，整體利率走勢仍維持偏空震盪看待。

**期貨市場**

週三離岸人民幣在6.83附近整理，日內區間約200點。年節前市場交投表現清淡，預估今日市場走勢將可能於6.82價位上下震盪整理，估計農曆年後才會較明顯方向。離岸人民幣換匯點下滑，一個月270(-65)，一年2670(-95)。人民幣匯率期貨昨日封關。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 01/25 | US | MBA 貸款申請指數 | 20-Jan | -- | 4.00% | 0.80% |
| 01/25 | CH | Industrial Profits YoY | Dec | -- | -- | 14.50% |
| 01/26 | TA | Monitoring Indicator | Dec | -- | -- | 26 |
| 01/26 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 21-Jan | 247k | -- | 234k |
| 01/26 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 14-Jan | 2040k | -- | 2046k |
| 01/26 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Jan P | 54.4 | -- | 53.9 |
| 01/26 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Jan P | -- | -- | 54.1 |
| 01/26 | US | 新屋銷售 | Dec | 588k | -- | 592k |
| 01/26 | US | 新屋銷售 (月比) | Dec | -0.70% | -- | 5.20% |
| 01/26 | US | 領先指數 | Dec | 0.50% | -- | 0.00% |
| 01/26 | US | 堪薩斯城聯邦製造業展望企業活動指數 | Jan | 8 | -- | 11 |

**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。**