

**Market News**

**2017/02/08**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.048 | 31.05 | 30.93 |
| USD/CNY | 6.863 | 6.8853 | 6.8625 |
| USD/CNH | 6.8352 | 6.8395 | 6.7953 |
| USD/JPY | 112.39 | 112.58 | 111.6 |
| EUR/USD | 1.0683 | 1.075 | 1.0656 |
| AUD/USD | 0.7628 | 0.7681 | 0.7606 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0.03 |
| TAIBOR 3M | | 0.65922 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.1367 | -0.7256 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.14 | -0.2969 |
| TW IRS 3Y | | 0.8596 | -0.008 |
| TW IRS 5Y | | 1.0965 | -0.0035 |
| TW 5Y BOND | | 0.8205 | -0.0035 |
| TW 10Y BOND | | 1.152 | -0.0105 |
| SHIBOR O/N | | 2.281 | 0.003 |
| SHIBOR 1M | | 3.9304 | 0.0273 |
| SHIBOR 3M | | 4.016 | 0.0663 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.474 | -0.023 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68833 | -0.00445 |
| USD LIBOR 3M | | 1.03844 | 0.00444 |
| USD 10Y BOND | | 2.3931 | -0.0183 |
| USD 30Y BOND | | 3.0179 | -0.0351 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.05 | -0.5 |
| WTI | | 52.17 | -0.63 |
| GOLD | | 1233.85 | -0.06 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20090.29 | 37.87 |
| Nasdaq | | 5674.217 | 10.665 |
| S&P 500 | | 2293.08 | 0.52 |
| DAX | | 11549.44 | 39.6 |
| SSEA | | 3305.801 | -4.096 |
| HIS | | 23348.24 | -16.67 |
| TAIEX | | 9554.56 | -34.82 |
| Nikkei 225 | | 18910.78 | 57.17 |
| KOSPI | | 2075.21 | -20.36 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 渣打銀行公佈的一項專有指數顯示，主要國際金融中心的人民幣使用量去年減少10.5%，在12月降至29個月低位。渣打銀行表示，中國當局採取的管控措施也抑制了離岸人民幣的使用。該行並表示，“資本管控加強、揮之不去的當局干預疑慮以及貶值預期，令真正的離岸人民幣使用者保持謹慎”。
* 美國12月貿易逆差收窄，因出口升至近一年半高點，受技術產品創紀錄提振，但國內需求增長直指進口進一步增加，可能會限制經濟增長。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週二收貶逾1角。儘管台股高檔持穩，但韓元走弱，外資反手買匯，令台幣自20個月高位拉回貶破31大關。外商銀昨日在匯市方向不一致，上午仍有不少拋匯，不過午後外商銀的買盤就明顯增多。而在台幣貶破31大關後，也引發出口商不少美元賣盤出籠。昨日外資動作分歧，不若先前持續匯入，也許意味著台幣走向雖不必然趨貶，但未來升幅或可能受限，未來將持續關注外資動向及其他亞幣的表現。預計今天成交區間在30.900~31.100。

**貨幣市場**

臺灣銀行間短率周二持穩低檔。提存期初資金雖然寬鬆，但感覺分配不均，除大型龍頭銀行因政府基金走錢沒開門外，行庫也為了因應明日國庫借款拆入資金，利率則持穩在既有水準。人民幣市場部分，隔拆利率在1.30%-2.30%，一年天期cnh swap落在 2,280 -2,420。

**債券市場**

週二美國公佈12月貿易數據好於預期，12月贸易逆差收窄，因出口升至近一年半高點，股市小幅上揚，債券市場區間震盪整理，終場10年期美債利率下滑1.5bps收2.393%；30年期利率下滑3bps收3.018%，今日市場無重要數據公布，美債10年利率目前於2.40%附近震盪整理，若向下突破整體偏空走勢可能趨於區間震盪。

**期貨市場**

週二離岸人民幣走貶，從本波高點6.80貶值300多點，來到6.8342，目前接近從6.90-6.87所形成之下降趨勢線，估計突破上檔難度高，先看6.855壓力關卡。離岸人民幣換匯點變化不大，一個月235(+0)，一年期2405(-15)。期貨週二成交1175口，成交約當金額0.40億美金，留倉口數2612口，約當留倉金額0.88億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/07 | TA | 貿易收支 | Jan | $3.67b | $3.50b | $4.86b |
| 02/07 | TA | 出口(年比) | Jan | 8.00% | 7.00% | 14.00% |
| 02/07 | TA | 進口(年比) | Jan | 10.40% | 8.40% | 13.20% |
| 02/07 | US | 貿易收支 | Dec | -$45.0b | -$44.3b | -$45.2b |
| 02/07 | CH | 外匯存底 | Jan | $3003.5b | $2998.2b | $3010.5b |
| 02/08 | TA | CPI(年比) | Jan | 2.02% | 2.25% | 1.70% |
| 02/08 | TA | WPI(年比) | Jan | 1.50% | 2.72% | 1.41% |
| 02/08 | US | MBA 貸款申請指數 | 3-Feb | -- | -- | -3.20% |
| 02/08-02/18 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Jan | 1.40% | -- | 5.70% |

**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。**