

**Market News**

**2017/02/09**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.128 | 31.135 | 31.03 |
| USD/CNY | 6.8853 | 6.8923 | 6.8638 |
| USD/CNH | 6.8422 | 6.8569 | 6.8329 |
| USD/JPY | 111.93 | 112.54 | 111.63 |
| EUR/USD | 1.0698 | 1.0714 | 1.0641 |
| AUD/USD | 0.7645 | 0.7666 | 0.7612 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | -0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.1893 | 0.0526 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.1421 | 0.0021 |
| TW IRS 3Y | | 0.8558 | -0.0092 |
| TW IRS 5Y | | 1.07 | 0 |
| TW 5Y BOND | | 0.808 | -0.004 |
| TW 10Y BOND | | 1.1065 | -0.018 |
| SHIBOR O/N | | 2.2765 | -0.0045 |
| SHIBOR 1M | | 3.9601 | 0.0297 |
| SHIBOR 3M | | 4.1094 | 0.0934 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.45 | -0.024 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68778 | -0.00055 |
| USD LIBOR 3M | | 1.03817 | -0.00027 |
| USD 10Y BOND | | 2.3363 | -0.055 |
| USD 30Y BOND | | 2.9485 | -0.0581 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.05 | 0.07 |
| WTI | | 52.34 | 0.13 |
| GOLD | | 1241.53 | -2.5 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20054.34 | -35.95 |
| Nasdaq | | 5682.454 | 8.237 |
| S&P 500 | | 2294.67 | 1.59 |
| DAX | | 11543.38 | -6.06 |
| SSEA | | 3301.705 | 14.563 |
| HIS | | 23331.57 | 153.56 |
| TAIEX | | 9543.25 | 16.93 |
| Nikkei 225 | | 19007.6 | -82.79 |
| KOSPI | | 2065.08 | -0.71 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 紐西蘭央行週四暗示不再可能進一步降息，但要收緊政策可能也要等兩年甚至更長時間，承諾將在“相當長一段時期內”維持指標利率在紀錄低位元1.75%不變。市場將這一承諾視為央行立場偏溫和。
* 英國首相Theresa May贏得議會下院支援啟動退歐進程，投票結果通過了授權Theresa May啟動脫歐進程的議案，標誌著英國朝著啟動兩年退歐談判進程的方向邁出了重大一步。該議案現在需要得到議會上院的通過，才能成為法律。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元周三收貶。亞幣變化不大，但韓元走貶且台股走弱，外資在股市擴大賣超並匯出，使台幣兌美元連兩日收貶。短期內還需密切關注美國政經情勢的變化。台幣自1月初至日前，累積漲幅最大也已到達1.3角，外資波段匯入的力道顯露疲態，不排除藉著外商銀買匯的動力，將台幣推向31.2。至於美國總統特朗普近期陸續推出的新政仍是市場關注焦點。台幣日前升至30.800的價位看來是滿足點，而且回貶後幅度也頗快。目前31.100-31.200的區間料將吸引部分出口商拋匯，預期台幣可能會在此間水位落入盤整。預計今天成交區間在31.000~31.150。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周三穩在低檔。有逾500億台幣國庫借款交割，銀行間資金分配不均，但因在提存期初且通貨回籠，拆款利率尚能穩在既有區間。人民幣市場部分，隔拆利率在1.20%-2.00%，一年天期cnh swap落在 2,280 -2,420。

**債券市場**

週三美國無重要數據公布，股市小幅走跌，加上川普上任後短期內出台財政政策的可能性降低，使得美債利率走勢拉回，終場10年期美債利率下滑5.7bps收2.336%；30年期利率下滑6.9bps收2.949%，今日關注美國上週初請失業金人數，美債10年券利率進一步向下突破2.40%，短線利率走勢將持續拉回整理，10年券區不排除下向回測2.20%。

**期貨市場**

週三離岸人民幣續貶，開盤後不久旋即緩步上攻，突破6.85，最高來到6.8568，在下降趨勢線6.86位置遭遇反壓，之後緩步走升，目前操作上仍偏區間操作，區間落在6.86-6.80。離岸人民幣換匯點下跌，一個月195(-40)，一年期2330(-75)。期貨週三成交2564口，成交約當金額0.66億美金，留倉口數2640口，約當留倉金額0.88億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 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 | -- | 2.30% | -3.20% |
| 02/09 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 4-Feb | 249k | -- | 246k |
| 02/09 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 28-Jan | 2058k | -- | 2064k |
| 02/09-02/18 | 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。**