

**Market News**

**2017/03/02**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.76 | 30.788 | 30.68 |
| USD/CNY | 6.867 | 6.882 | 6.8727 |
| USD/CNH | 6.8716 | 6.8773 | 6.853 |
| USD/JPY | 113.73 | 114.05 | 112.76 |
| EUR/USD | 1.0547 | 1.0589 | 1.0514 |
| AUD/USD | 0.7677 | 0.77 | 0.7637 |
| **Interest Rate** | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | 0.169 | -0.005 |
| TAIBOR 3M | 0.65944 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | 4.2243 | -0.181 |
| CNT TAIBOR 1Y | 4.8 | -0.2287 |
| TW IRS 3Y | 0.8779 | 0.0029 |
| TW IRS 5Y | 1.115 | 0.005 |
| TW 5Y BOND | 0.82 | -0.005 |
| TW 10Y BOND | 1.121 | -0.0006 |
| SHIBOR O/N | 2.4943 | 0.0013 |
| SHIBOR 1M | 4.0763 | -0.0037 |
| SHIBOR 3M | 4.2881 | 0.004 |
| CN 7Y BOND | 3.192 | 0.021 |
| CN 10Y BOND | 3.377 | 0.056 |
| USD LIBOR O/N | 0.68056 | -0.00277 |
| USD LIBOR 3M | 1.064 | 0.00944 |
| USD 10Y BOND | 2.4526 | 0.0609 |
| USD 30Y BOND | 3.0608 | 0.0608 |
| **Commodity** | **Last** | **Chg** |
| BRENT | 56.36 | -0.02 |
| WTI | 53.83 | -0.09 |
| GOLD | 1249.69 | -2.44 |
| **Stock** | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | 21115.55 | 303.31 |
| Nasdaq | 5904.029 | 78.591 |
| S&P 500 | 2395.96 | 32.32 |
| DAX | 12067.19 | 232.78 |
| SSEA | 3394.498 | 5.394 |
| HIS | 23740.73 | 35.76 |
| TAIEX | 9674.78 | 79.8 |
| Nikkei 225 | 19393.54 | 214.9 |
| KOSPI | 2091.64 | 16.11 |
| Source: Bloomberg |



* 達拉斯聯邦儲備銀行總裁柯普朗表示，美國國內經濟強勁與海外形勢穩定，已經為升息創造機會。“我認為經濟強健程度足以讓我們實施(升息)，”柯普朗指出。“我們應當儘早開始這一過程，以確保升息是漸進且充滿耐心的。”另外，美聯儲理事布雷納德則表示，全球經濟改善與美國穩健復蘇，說明美聯儲“很快將適宜”升息，為美聯儲官員暗示最早可能3月加息的行動再添重要一筆。
* 加拿大央行維持利率不變，關注經濟面臨的“巨大不確定性”，儘管央行指出，第四季成長可能強於預期。加拿大央行稱，未考慮能源價格上漲將1月通脹率推升至2%之上所產生的臨時性影響。央行指出，基礎通脹低迷，表明經濟中仍存在大量閒置。央行表示，仍在繼續關注1月貨幣政策報告中提及的各種風險，其中包括美國新總統特朗普將要推出的政策不夠明朗等。

**Market Recap**

**外匯市場**

 台幣兌美元 周三收貶1.1角，自21個月高位滑落。長假期間市場對美聯儲3月升息機率走高，推升美元，午後外資匯出趨於明顯，加劇台幣貶幅。預計台幣今日區間在30.700-30.850之間。

**貨幣市場**

 台灣銀行間短率周三區間偏跌。時序邁入月初，資金情勢較顯寬鬆，短率也隨著月底效應過去而轉趨回歸低檔區間整理。人民幣市場部分，隔拆利率在1.20%-2.50%，一年天期cnh swap落在 1,960 -2,095。

**債券市場**

 週三美國公佈數據大致偏穩，核心PCE持穩於1.7%，2月ISM製造業上升至57.7為兩年半來高點，顯示目前美國經濟狀況穩定，而物價暫無立即性上行壓力，昨日美債利率持續彈升，終場美債10年券利率上揚6.3bps收2.453%；30年券利率上揚6.6bps收3.061%，今日市場關注初請失業金數據，短線美債10年券暫維持於2.40%上下震盪整理。

**期貨市場**

 週三離岸人民幣走貶，fed三月份會議升息機率提升，令國際美元走強，昨日美國公布數據平穩，人民幣走勢料預料維持高檔震盪。昨日離岸人民幣換匯點下挫，一個月持平170，一年期2200(+100)。人民幣匯率期貨市場週三成交1,292口，約當成交金額0.498億美金，留倉口數3663口，約當留倉金額1.345億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date  | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 03/01 | TA | 日經台灣製造業採購經理人指數 | Feb | -- | 54.5 | 55.6 |
| 03/01 | CH | 非製造業PMI | Feb | -- | 54.2 | 54.6 |
| 03/01 | CH | 製造業PMI | Feb | 51.2 | 51.6 | 51.3 |
| 03/01 | CH | 財新中國製造業採購經理人指數 | Feb | 50.8 | 51.7 | 51 |
| 03/01 | US | MBA 貸款申請指數 | 24-Feb | -- | 5.80% | -2.00% |
| 03/01 | US | 個人所得 | Jan | 0.30% | 0.40% | 0.30% |
| 03/01 | US | 個人支出 | Jan | 0.30% | 0.20% | 0.50% |
| 03/01 | US | 核心PCE(月比) | Jan | 0.30% | 0.30% | 0.10% |
| 03/01 | US | 核心PCE(年比) | Jan | 1.70% | 1.70% | 1.70% |
| 03/01 | US | Markit美國製造業採購經理人指數 | Feb F | 54.5 | 54.2 | 54.3 |
| 03/01 | US | ISM 製造業指數 | Feb | 56.2 | 57.7 | 56 |
| 03/01 | US | 營建支出 (月比) | Jan | 0.60% | -1.00% | -0.20% |
| 03/02 | US | U.S. Federal Reserve Releases Beige Book |  |  |  |  |
| 03/02 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 25-Feb | 245k | -- | 244k |
| 03/02 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 18-Feb | 2060k | -- | 2060k |

**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。**