

**Market News**

**2017/04/21**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.408 | 30.47 | 30.391 |
| USD/CNY | 6.888 | 6.8911 | 6.8815 |
| USD/CNH | 6.8845 | 6.8873 | 6.8787 |
| USD/JPY | 109.32 | 109.49 | 108.72 |
| EUR/USD | 1.0717 | 1.0778 | 1.0709 |
| AUD/USD | 0.7527 | 0.7547 | 0.7493 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.173 | -0.001 |
| TAIBOR 3M | | 0.65811 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 3.9879 | 0.1119 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 4.4229 | 0.0389 |
| TW IRS 3Y | | 0.7839 | 0.0064 |
| TW IRS 5Y | | 0.965 | 0.005 |
| TW 5Y BOND | | 0.7535 | -0.0045 |
| TW 10Y BOND | | 0.995 | -0.005 |
| SHIBOR O/N | | 2.5987 | 0.0237 |
| SHIBOR 1M | | 4.005 | 0.0042 |
| SHIBOR 3M | | 4.2725 | 0.0064 |
| CN 7Y BOND | | 3.393 | 0.19 |
| CN 10Y BOND | | 3.435 | 0.02 |
| USD LIBOR O/N | | 0.93 | 0 |
| USD LIBOR 3M | | 1.15567 | -0.00055 |
| USD 10Y BOND | | 2.232 | 0.0248 |
| USD 30Y BOND | | 2.8822 | 0.0139 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 52.99 | 0.07 |
| WTI | | 50.71 | 0.08 |
| GOLD | | 1281.9 | -0.74 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20578.71 | 174.22 |
| Nasdaq | | 5916.777 | 53.743 |
| S&P 500 | | 2355.84 | 17.67 |
| DAX | | 12027.32 | 10.87 |
| SSEA | | 3320.23 | 0 |
| HIS | | 24057.21 | -31.25 |
| TAIEX | | 9632.69 | -7.25 |
| Nikkei 225 | | 18430.49 | -1.71 |
| KOSPI | | 2149.15 | 10.75 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 德國財政部表示，德國經濟好轉勢頭今年第一季可能加快，推動稅收增長超過預期。財政部月報中稱，最近的產出數據、未來訂單以及不斷增長的就業，都表明今年前三個月經濟活動加速。
* 美國上周初請失業金人數增加10,000人，經季節調整後至24.4萬人，增幅略高於預期，但續請失業金人數則降至17年低位，表明勞動力市場持續緊俏。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週四隨韓元略收升。台幣成交量能偏少且一直在平盤附近盤整，未見明確方向，台股也未見大幅漲跌，市場觀望週末法國選舉結果的氣氛相當濃厚。外商銀未見特定方向，昨日買賣美元都有，不過出口商的拋匯量稍大，因此美元高位倒也有限。台股近期方向並不明確，但目前股市陷於一個月低檔，恐怕後續若未有外資大幅進場，也難有大升的動力。至於法國撲朔迷離的總統大選選情，則令市場更加保守觀望。預計今日交易區間在30.350～30.500。

**貨幣市場**

　　台灣銀行間短率周四持穩低位。經過提存期初以來一輪調整後，縱然市場資金仍舊充沛，但短率大致已經穩在低位，除了到期續作外，新增需求仍低。人民幣市場部分，隔夜價格在1.80%-2.40，一年天期cnh swap落在 1,730 -1,740。

**債券市場**

週四美國公佈數據好壞不一，初請失業金人數小幅增加，但續請失業金人數縮減至近17年新低，顯示美國目前就業市場依舊穩健，而昨日美債市場受美股上漲激勵彈升，10年期美債利率小幅上揚1.8bps收2.232%；30年期美債利率小幅上揚1bps收2.882%，今日美國關注Markit PMI與成屋銷售公佈，短線10年券未突破2.30%前建議逢高邊多操作。

**期貨市場**

人民幣兌美元即期週四小幅收升，中間價明顯回落。昨日中間價跌幅遠小於預期，估計監管啟動了過濾機制，這也凸顯監管維穩意圖，不希望人民幣因購匯需求出清而下跌；午後歐元上漲壓低美元指數，進而提振人民幣走勢，近期的實需還是蠻多，但大行適度提供美元流動性，令美元兌人民幣6.89上方阻力依然明顯。而外管局最新公佈的3月結售匯資料整體良好，結合近期監管放鬆管制舉措，預計4月資料也或繼續趨於平衡，資金外流壓力有望進一步緩解。換匯點一個月小幅降至(-13)，一年期亦下滑至1705(-33)。人民幣匯率期貨市場週四成交量為706口，約當金額0.2236億美元，留倉口數2,719口，約當留倉金額1.0022億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 04/20 | TA | 出口訂單(年比) | Mar | 8.80% | 12.30% | 22.00% |
| 04/20 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 15-Apr | 240k | 244k | 234k |
| 04/20 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 8-Apr | 2024k | 1979k | 2028k |
| 04/20 | US | 費城聯準企業展望 | Apr | 25.5 | 22 | 32.8 |
| 04/20 | US | 領先指數 | Mar | 0.20% | 0.40% | 0.60% |
| 04/21 | US | Markit美國製造業採購經理人指數 | Apr P | 53.8 | -- | 53.3 |
| 04/21 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Apr P | 53.2 | -- | 52.8 |
| 04/21 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Apr P | -- | -- | 53 |
| 04/21 | US | 成屋銷售 | Mar | 5.60m | -- | 5.48m |
| 04/21 | US | 成屋銷售 (月比) | Mar | 2.20% | -- | -3.70% |

**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。**