

**Market News**

**2016/12/07**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.952 | 31.97 | 31.89 |
| USD/CNY | 6.8818 | 6.8843 | 6.8631 |
| USD/CNH | 6.8878 | 6.888 | 6.8583 |
| USD/JPY | 114.02 | 114.19 | 113.5 |
| EUR/USD | 1.0718 | 1.0785 | 1.0698 |
| AUD/USD | 0.7461 | 0.7483 | 0.7431 |
| **Interest Rate** | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | 0.2 | 0 |
| TAIBOR 3M | 0.65811 | -0.00089 |
| CNT TAIBOR 3M | 5.7733 | -0.0624 |
| CNT TAIBOR 1Y | 4.8267 | 0.0231 |
| TW IRS 3Y | 0.8662 | -0.0088 |
| TW IRS 5Y | 1.08 | -0.0025 |
| TW 5Y BOND | 0.8251 | -0.0549 |
| TW 10Y BOND | 1.088 | -0.002 |
| SHIBOR O/N | 2.299 | -0.009 |
| SHIBOR 1M | 2.9756 | 0.0299 |
| SHIBOR 3M | 3.1039 | 0.015 |
| CN 7Y BOND | 3.127 | 0.063 |
| CN 10Y BOND | 3.108 | 0.042 |
| USD LIBOR O/N | 0.43478 | 0 |
| USD LIBOR 3M | 0.94806 | 0.00167 |
| USD 10Y BOND | 2.3887 | -0.0017 |
| USD 30Y BOND | 3.0788 | 0.014 |
| **Commodity** | **Last** | **Chg** |
| BRENT | 53.93 | -0.24 |
| WTI | 50.93 | -0.2 |
| GOLD | 1169.85 | -1.26 |
| **Stock** | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | 19251.78 | 35.54 |
| Nasdaq | 5333 | 24.108 |
| S&P 500 | 2212.23 | 7.52 |
| DAX | 10775.32 | 90.49 |
| SSEA | 3355.631 | -5.379 |
| HIS | 22505.55 | 169.6 |
| TAIEX | 9250.77 | 33.62 |
| Nikkei 225 | 18360.54 | 124.21 |
| KOSPI | 1989.86 | 3.35 |
| Source: Bloomberg |



* 美國10月貿易逆差創逾一年半最大增幅，因大豆等商品出口下降，美國商務部周二稱，10月貿易逆差擴闊17.8%，至426億美元，為2015年3月以來最大增幅，因大豆等商品的出口下降，表明貿易將拖累第四季經濟成長。
* 美國總統當選人特朗普周二與日本軟銀社長孫正義會面時稱，軟銀計劃在美國投資500億美元，創造5萬個新工作崗位。根據華爾街日報，投資資金將來自一規模為1千億美元的投資基金，孫正義正與沙特主權財富基金以及其他潛在夥伴共同設立該基金。他對記者表示，他的公司將在美國投資初創企業，從而創造就業機會。

**Market Recap**

**外匯市場**

 台幣兌美元週二小幅收升，結束先前連五日跌勢。交易員表示，亞幣回神帶動台幣走揚，出口商今日拋匯頗凶，但交易量縮；外資雖持續買匯，不過短期內32大關可能不易跌破。匯銀人士稱，昨日歐洲股市大幅反彈，今日新興亞幣多隨股市走強。臺灣匯市方面，原本前日美元價量俱揚，但昨日甚至並未嘗試站上32大關，因此預估，32關卡雖近在眼前，但可能還要一些時日整理才能打破。今日台幣兌美元區間暫看31.850-32.000。

**貨幣市場**

 台灣銀行間短率周二穩中偏升。美國晶片商美光MU.O收購華亞科技的800億台幣聯貸案交割，令調度需求升溫，惟外商銀行資金略見好轉，使得利率高位僅稍稍上揚。人民幣市場方面，隔拆利率在4.00%-13.00%，一年天期cnh swap落在 2,170 -2,250。

**債券市場**

 週二美國公布10月份工廠訂單小幅優於市場預期，10月訂單成長2.7%，市場預估成長2.6，目前市場在無重要消息引導，走勢偏向震盪整理，終場10年期美債利率下滑0.5bps收2.391%；30年期上揚1.5bps收3.079%，今日市場無重要數據公佈，利率走勢預估維持偏空震盪。

**期貨市場**

週二離岸人民幣回貶，終止連續6個交易日走升。亞洲盤受美元走升影響一路回貶，午盤一路貶至6.8845，歐洲盤進來匯率呈現區間震盪。離岸人民幣換匯點，由近期高點回落，一個月降至330(-100)，一年降至2180(-125)，離岸人民幣流動性持續處於高位。期貨週二成交2595口，成交約當金額0.906億美金，留倉口數3698口，約當留倉金額1.242億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date  | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 12/06 | TA | CPI(年比) | Nov | 1.50% | 1.97% | 1.70% |
| 12/06 | TA | WPI(年比) | Nov | -1.05% | -0.28% | -1.88% |
| 12/06 | US | 貿易收支 | Oct | -$42.0b | -$42.6b | -$36.4b |
| 12/06 | US | 非農業生產力 | 3Q F | 3.30% | 3.10% | 3.10% |
| 12/06 | US | 單位勞工成本 | 3Q F | 0.30% | 0.70% | 0.30% |
| 12/06 | US | 工廠訂單 | Oct | 2.60% | 2.70% | 0.30% |
| 12/06 | US | 工廠訂單(運輸除外) | Oct | -- | 0.80% | 0.60% |
| 12/06 | US | 耐久財訂單 | Oct F | 3.40% | 4.60% | 4.80% |
| 12/06 | US | 耐久財(運輸除外) | Oct F | 0.50% | 0.80% | 1.00% |
| 12/06 | US | 資本財新訂單非國防(飛機除外) | Oct F | -- | 0.20% | 0.40% |
| 12/07 | TA | 貿易收支 | Nov | $3.08b | -- | $4.38b |
| 12/07 | TA | 出口(年比) | Nov | 9.30% | -- | 9.40% |
| 12/07 | TA | 進口(年比) | Nov | 6.00% | -- | 19.50% |
| 12/07 | US | MBA 貸款申請指數 | 2-Dec | -- | -- | -9.40% |
| 12/07 | CH | 外匯存底 | Nov | $3060.7b | -- | $3120.7b |

**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。**