

**Market News**

**2017/01/10**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 32.106 | 32.135 | 32.015 |
| USD/CNY | 6.9241 | 6.9383 | 6.93 |
| USD/CNH | 6.8797 | 6.8897 | 6.8371 |
| USD/JPY | 116.03 | 117.53 | 115.96 |
| EUR/USD | 1.0574 | 1.0583 | 1.0511 |
| AUD/USD | 0.7354 | 0.7374 | 0.7289 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | -0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 9.602 | -0.5557 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 6.636 | -0.1248 |
| TW IRS 3Y | | 0.9243 | 0 |
| TW IRS 5Y | | 1.15 | -0.005 |
| TW 5Y BOND | | 0.819 | -0.0205 |
| TW 10Y BOND | | 1.1575 | 0.0033 |
| SHIBOR O/N | | 2.094 | -0.018 |
| SHIBOR 1M | | 3.4738 | 0.0637 |
| SHIBOR 3M | | 3.5152 | 0.0764 |
| CN 7Y BOND | | 3.174 | -0.013 |
| CN 10Y BOND | | 3.176 | -0.037 |
| USD LIBOR O/N | | 0.691 | -0.00122 |
| USD LIBOR 3M | | 1.01011 | 0.00083 |
| USD 10Y BOND | | 2.3647 | -0.0565 |
| USD 30Y BOND | | 2.958 | -0.0524 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 57.1 | -2.16 |
| WTI | | 51.96 | 0.06 |
| GOLD | | 1181.1 | 1.36 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19887.38 | -76.42 |
| Nasdaq | | 5531.818 | 10.763 |
| S&P 500 | | 2268.9 | -8.08 |
| DAX | | 11563.99 | -35.02 |
| SSEA | | 3302.791 | 17.741 |
| HIS | | 22503.01 | 55.68 |
| TAIEX | | 9342.42 | 4.76 |
| Nikkei 225 | | 19454.33 | -47.75 |
| KOSPI | | 2048.78 | -5.67 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 英國首相特雷莎梅周一表示，英國徹底退出歐盟單一市場並不是不可避免的，尋求澄清有關英國可能“硬性退歐”的言論，相關言論壓低了英鎊匯率。特雷莎梅周日曾在電視採訪中稱，英國可能無法保留“絲毫”歐盟成員國身份。
* 中國央行公布數據顯示，2016年末中國外匯儲備降至3.01萬億美元的近六年新低，全年減少3,198億美元，但降幅9.6%較上年的13%收窄。國家外匯管理局對此解釋稱，央行穩定人民幣匯率是外儲規模下降的主要原因；分析師則預計1月外儲將繼續走低。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週一開低收低且貶破32元大關。受國際美元強勁反彈衝擊，今天韓元和日圓等亞幣均走貶，加上外資呈淨匯出，致台幣連二日收貶。因上周美國公佈的非農就業資料穩健，帶動美元走強，台幣昨日跟隨亞幣走貶，惟交投偏冷，成交量明顯萎縮。在美元持續走強的情況下，昨天亞幣均偏貶，韓元貶值更是逾1%，台幣除受外在環境影響，外資亦呈淨匯出，使台幣再度貶破32元整數關卡。短線觀察重點在美元是否續彈及外資動向。今日成交區間暫看32.000~32.150。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周一穩於低位。市場資金寬裕，需求不振，央行也持續減少沖銷，營造年前寬鬆的資金環境。人民幣市場波動劇烈，隔拆利率在4.00%-15.00%，一年天期cnh swap落在 3,225 -3,350。

**債券市場**

週一美國無重要數據公布，英國首相特里莎·梅表示該國退出歐盟之後需要新的英歐貿易關係，令人擔心她可能放棄單一市場准入，昨日美債利率下跌，終場10年期利率下跌5.5bps收2.365%；30年期利率下滑5bps收2.958%，本週後續市場關注物價、銷售與消費信心指數，短線美債10年券於2.40%上下震盪，操作暫以區間操作為宜。

**期貨市場**

週一離岸人民幣漲續貶，亞洲開盤一路急貶，從6.85貶至6.87，而人民幣中間價公布後再貶200點，最低來到6.89，晚間隨即在6.88整理。目前籌碼較為凌亂，方向未明，本週離岸人民幣估計會是動能主導但維持在箱型整理的格局。離岸人民幣換匯點續跌，一個月660(-115)，一年3255(-140)。期貨週一成交876口，成交約當金額0.27億美金，留倉口數4242口，約當留倉金額1.36億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 01/09 | TA | 貿易收支 | Dec | $4.37b | $4.86b | $4.27b |
| 01/09 | TA | 出口(年比) | Dec | 10.40% | 14.00% | 12.10% |
| 01/09 | TA | 進口(年比) | Dec | 10.00% | 13.20% | 3.00% |
| 01/10 | CH | CPI(年比) | Dec | 2.20% | -- | 2.30% |
| 01/10 | CH | PPI(年比) | Dec | 4.60% | -- | 3.30% |
| 01/10-01/15 | CH | 貨幣供給M0年比 | Dec | 7.00% | -- | 7.60% |
| 01/10-01/15 | CH | 貨幣供給M1年比 | Dec | 22.00% | -- | 22.70% |
| 01/10-01/15 | CH | 貨幣供給M2(年比) | Dec | 11.40% | -- | 11.40% |
| 01/10-01/15 | CH | 社會融資(人民幣) | Dec | 1300.0b | -- | 1740.0b |
| 01/10-01/15 | CH | New Yuan Loans CNY | Dec | 676.8b | -- | 794.6b |
| 01/10-01/18 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Dec | 0.80% | -- | -- |

**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。**