

**Market News**

**2017/02/03**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.101 | 31.25 | 31.02 |
| USD/CNY | 6.8836 | 6.8842 | 6.872 |
| USD/CNH | 6.8079 | 6.8352 | 6.8002 |
| USD/JPY | 112.75 | 113.63 | 112.06 |
| EUR/USD | 1.0788 | 1.0829 | 1.0732 |
| AUD/USD | 0.7586 | 0.7597 | 0.7552 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | -0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65911 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 6.3987 | 0.0207 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.674 | -0.058 |
| TW IRS 3Y | | 0.8824 | 0 |
| TW IRS 5Y | | 1.14 | 0 |
| TW 5Y BOND | | 0.817 | -0.013 |
| TW 10Y BOND | | 1.1216 | -0.0534 |
| SHIBOR O/N | | 2.5293 | 0.3643 |
| SHIBOR 1M | | 3.851 | 0.0215 |
| SHIBOR 3M | | 3.8706 | 0.0155 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.365 | 0.01 |
| USD LIBOR O/N | | 0.69111 | 0.00111 |
| USD LIBOR 3M | | 1.03456 | 0 |
| USD 10Y BOND | | 2.4737 | 0.0094 |
| USD 30Y BOND | | 3.0877 | 0.0174 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 56.56 | 0.3 |
| WTI | | 53.54 | 0.29 |
| GOLD | | 1215.5 | 0.41 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 19884.91 | -6.03 |
| Nasdaq | | 5636.197 | -6.453 |
| S&P 500 | | 2280.85 | 1.3 |
| DAX | | 11627.95 | -31.55 |
| SSEA | | 3297.957 | 10.105 |
| HIS | | 23318.39 | -133.87 |
| TAIEX | | 9428.97 | 38.31 |
| Nikkei 225 | | 18914.58 | 115.44 |
| KOSPI | | 2071.01 | 0.09 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國上周初請失業金人數降幅超過預期，直指勞動力市場狀況收緊，應該能夠在今年支撐經濟。第四季非農勞動生產率增長放緩，經濟學家稱，表明企業需繼續雇傭以增加產出。這種情況開始給薪資施加上行壓力，為美聯儲今年升息鋪平道路。
* 英國央行上調2017年英國經濟成長預估至2.0%，但警告稱脫歐道路曲折，不過，英國央行釋出的普遍信號是，即便英鎊走軟推動物價快速攀升，並不擔心處於紀錄低位元的利率。英國決定維持利率在0.25%的紀錄低位元不變，且保持現有的刺激計畫規模。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週四開紅盤收升逾2角，創逾19個月高位。因農曆春節休假期間，美元表現較封關前偏弱，再加上美聯儲(FED)並未發出近期升息信號的效應帶動，令台幣一舉升破去年8月壓力區。不過雖然台幣價格表現強勢，但成交量卻相對平穩，只是反映近日美元的弱勢，實質買賣美元的需求並不強，買盤承接力道不足，觀望氣氛較為濃厚，才會讓台幣匯價在外資不算強勢的匯入力道帶動下，突破前波技術壓力並朝31.000關卡挑戰。預計今天成交區間在31.000~31.150。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周四趨跌。新春開年報價較顯混亂，銀行間資金寬裕對票券商一周拆款報價開低走低，而2/3為旬底最後交易日料交投續向區間低位靠攏。人民幣市場部分，隔拆利率在1.40%-1.60%，一年天期cnh swap落在 2,640 -2,750。

**債券市場**

週四美國公布經濟數據表現穩定，上週初請失業金人數減少1.4萬人來到24.6萬人，持續位於歷史紀錄低檔整理，昨日美債利率小幅震盪觀望今日非農就業報告，終場美債10年券利率小幅上揚0.4bps收2.474%；30年券利率上揚1.3bps收3.088%，今日市場關注美國非農就業報告，整體利率走勢仍維持偏空震盪看待。

**期貨市場**

週四離岸人民幣走升，從6.83升破6.81，最高升值至6.7993。周四在亞洲盤亞幣走升及中國仍處於休假期間下，離岸人民幣升破6.81，美國盤人民幣升破6.80關卡後回吐漲幅，終場收6.8094。離岸人民幣換匯點小跌，一個月288，一年期2665(-130)。期貨週四成交527口，成交約當金額0.21億美金，留倉口數2712口，約當留倉金額0.89億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/02 | US | 非農業生產力 | 4Q P | 1.00% | 1.30% | 3.10% |
| 02/02 | US | 單位勞工成本 | 4Q P | 1.90% | 1.70% | 0.70% |
| 02/02 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 28-Jan | 250k | 246k | 259k |
| 02/02 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 21-Jan | 2063k | 2064k | 2100k |
| 02/02 | CH | 財新中國製造業採購經理人指數 | Jan | 51.8 | -- | 51.9 |
| 02/03 | US | 非農業就業人口變動 | Jan | 180k | -- | 156k |
| 02/03 | US | 失業率 | Jan | 4.70% | -- | 4.70% |
| 02/03 | US | 平均時薪(月比) | Jan | 0.30% | -- | 0.40% |
| 02/03 | US | 平均時薪(年比) | Jan | 2.80% | -- | 2.90% |
| 02/03 | US | 勞動參與率 | Jan | -- | -- | 62.70% |
| 02/03 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Jan F | -- | -- | 55.1 |
| 02/03 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Jan F | -- | -- | 55.4 |
| 02/03 | US | ISM 非製造業綜合指數 | Jan | 57 | -- | 57.2 |
| 02/03 | US | 工廠訂單 | Dec | 0.50% | -- | -2.40% |
| 02/03 | US | 工廠訂單(運輸除外) | Dec | -- | -- | 0.10% |
| 02/03 | US | 耐久財訂單 | Dec F | -- | -- | -0.40% |
| 02/03 | US | 耐久財(運輸除外) | Dec F | -- | -- | 0.50% |
| 02/03 | US | 資本財新訂單非國防(飛機除外) | Dec F | -- | -- | 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。**