

**Market News**

**2017/02/06**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.05 | 31.08 | 30.949 |
| USD/CNY | 6.884 | 6.8742 | 6.864 |
| USD/CNH | 6.8025 | 6.8274 | 6.7926 |
| USD/JPY | 112.61 | 113.45 | 112.32 |
| EUR/USD | 1.0783 | 1.0798 | 1.0713 |
| AUD/USD | 0.768 | 0.7695 | 0.7622 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | -0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.659 | 0 |
| CNT TAIBOR 3M | | 6.555 | 0.1563 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.7393 | 0.0653 |
| TW IRS 3Y | | 0.8894 | 0 |
| TW IRS 5Y | | 1.145 | 0 |
| TW 5Y BOND | | 0.85 | 0.033 |
| TW 10Y BOND | | 1.24 | 0.1184 |
| SHIBOR O/N | | 2.2571 | 0.0391 |
| SHIBOR 1M | | 3.8907 | 0.0146 |
| SHIBOR 3M | | 3.9348 | 0.0173 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.423 | 0.058 |
| USD LIBOR O/N | | 0.69278 | 0.00445 |
| USD LIBOR 3M | | 1.034 | 0.00028 |
| USD 10Y BOND | | 2.4648 | -0.0182 |
| USD 30Y BOND | | 3.0902 | -0.0099 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 56.81 | 0.11 |
| WTI | | 53.83 | 0.1 |
| GOLD | | 1220.3 | 3.87 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20071.46 | 186.55 |
| Nasdaq | | 5666.766 | 30.569 |
| S&P 500 | | 2297.42 | 16.57 |
| DAX | | 11651.49 | 23.54 |
| SSEA | | 3308.062 | -19.897 |
| HIS | | 23184.52 | -55.31 |
| TAIEX | | 9455.56 | 41.63 |
| Nikkei 225 | | 18918.2 | 6.18 |
| KOSPI | | 2073.16 | 5.84 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國1月就業報告好於預期，但薪資成長放緩。1月非農就業增加22.7萬人，但失業率上升0.1個百分點至4.8%，薪資僅微升了3美分。此前市場預估就業增加18萬人，失業率為4.7%。
* 美國總統川普週五下令對2008年金融危機後頒佈的主要銀行業規定進行重新檢討。這一行動招致民主黨人的抨擊，稱他的命令缺乏實質內容。儘管這項政令缺乏細節，但金融市場仍欣然相信，特朗普在暗示即將放鬆銀行業監管。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元上週五小幅收升，續創逾19個月高位。美國總統特朗普近日抨擊他國匯率的效應持續發酵，外資雙向操作，進口商也積極承接，令成交量明顯擴大，但終場仍小幅收升，開紅盤短短兩個交易日共升值3.1角。上週四外資在台股現貨買超僅不到6億台幣，今日更反向賣超逾50億，若以此來解釋台幣這兩天的升值幅度是說不通的。因此只能說，亞洲新興貨幣普遍受到特朗普政策的壓力，未來是不是被迫繼續升值，還需觀察。預計今天成交區間在30.800~31.000。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周五持穩低位。台幣新春開紅盤、氣勢如虹，外資匯入墊高整體銀行間資金水位，加以年後通貨回籠也令金融機構普遍多錢、資金需求疲軟，帶動短率持續盤旋低檔。人民幣市場部分，隔拆利率在1.50%-2.50%，一年天期cnh swap落在 2,680 -2,780。

**債券市場**

週五美國公布非農就業報告雖好於市場預期，但平均時薪增幅放緩也令Fed有更多空間放緩升息步調，1月非農就業增加22.7萬人，市場預估18萬人；1月平均時薪年比上漲2.5%低於市場預估2.7%，10年期美債利率小幅下滑0.9bps收2.465%；30年期利率上揚0.3bps收3.09%，本週市場關注進口物價與消費信心公布，短線操作維持區間偏空。

**期貨市場**

週五離岸人民幣續升，升破6.80關卡，來到2016年美國總統選舉後的高點。周五亞洲盤人民幣持穩在6.82，市場靜待美國非農就業報告。週五就業報告表現不錯，新增就業優於預期，惟失業率及時薪表現不如預期，美元指數持平，離岸人民幣則是逆勢上漲，終場收6.8003。離岸人民幣換匯點小漲，一個月300(+12)，一年期2690(+25)。期貨週五成交136口，成交約當金額0.1億美金，留倉口數2738口，約當留倉金額0.91億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/03 | US | 非農業就業人口變動 | Jan | 180k | 227k | 156k |
| 02/03 | US | 失業率 | Jan | 4.70% | 4.80% | 4.70% |
| 02/03 | US | 平均時薪(月比) | Jan | 0.30% | 0.10% | 0.40% |
| 02/03 | US | 平均時薪(年比) | Jan | 2.70% | 2.50% | 2.90% |
| 02/03 | US | 勞動參與率 | Jan | -- | 62.90% | 62.70% |
| 02/03 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Jan F | -- | 55.6 | 55.1 |
| 02/03 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Jan F | -- | 55.8 | 55.4 |
| 02/03 | US | ISM 非製造業綜合指數 | Jan | 57 | 56.5 | 57.2 |
| 02/03 | US | 工廠訂單 | Dec | 0.50% | 1.30% | -2.40% |
| 02/03 | US | 工廠訂單(運輸除外) | Dec | -- | 2.10% | 0.10% |
| 02/03 | US | 耐久財訂單 | Dec F | -0.40% | -0.50% | -0.40% |
| 02/03 | US | 耐久財(運輸除外) | Dec F | -- | 0.50% | 0.50% |
| 02/03 | US | 資本財新訂單非國防(飛機除外) | Dec F | -- | 0.70% | 0.80% |
| 02/05 | CH | 財新中國綜合採購經理人指數 | Jan | -- | -- | 53.5 |
| 02/05 | CH | 財新中國服務業採購經理人指數 | Jan | -- | -- | 53.4 |
| 02/06 | TA | 外匯存底 | Jan | -- | -- | $434.20b |

**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。**