

**Market News**

**2017/02/07**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.943 | 30.988 | 30.83 |
| USD/CNY | 6.8672 | 6.8683 | 6.8565 |
| USD/CNH | 6.8079 | 6.8137 | 6.7963 |
| USD/JPY | 112.07 | 112.78 | 111.99 |
| EUR/USD | 1.0735 | 1.0802 | 1.0706 |
| AUD/USD | 0.7648 | 0.7684 | 0.763 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.21 | 0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0.00033 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.8623 | -0.6927 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.4369 | -0.3024 |
| TW IRS 3Y | | 0.8839 | -0.0037 |
| TW IRS 5Y | | 1.13 | -0.01 |
| TW 5Y BOND | | 0.822 | -0.033 |
| TW 10Y BOND | | 1.185 | -0.05 |
| SHIBOR O/N | | 2.278 | 0.0209 |
| SHIBOR 1M | | 3.9031 | 0.0124 |
| SHIBOR 3M | | 3.9497 | 0.0149 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.497 | 0.074 |
| USD LIBOR O/N | | 0.69278 | 0.00445 |
| USD LIBOR 3M | | 1.034 | 0.00028 |
| USD 10Y BOND | | 2.4077 | -0.0774 |
| USD 30Y BOND | | 3.0473 | -0.0527 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.72 | 0.24 |
| WTI | | 53.01 | 0.2 |
| GOLD | | 1230.8 | 1.79 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20052.42 | -19.04 |
| Nasdaq | | 5663.552 | -3.214 |
| S&P 500 | | 2292.56 | -4.86 |
| DAX | | 11509.84 | -141.65 |
| SSEA | | 3288.165 | 17.636 |
| HIS | | 23129.21 | 219.03 |
| TAIEX | | 9538.01 | -19.95 |
| Nikkei 225 | | 18976.71 | -126.41 |
| KOSPI | | 2077.66 | -4.91 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國費城聯邦儲備銀行總裁表示， FED下次會議時，應考慮升息。“我仍支持今年升息三次，當然這在很大程度上取決於經濟以及財政政策如何演變，”哈克就金融科技公司監管政策發表演講後對記者稱。“我認為3月可以考慮再升息25個基點。”
* 對於美國指責其操縱匯率，歐洲央行週一予以否認，並警告稱，華盛頓目前正在公開討論的放鬆銀行業監管的提議，可能為下一輪金融危機埋下隱患。歐洲央行總裁德拉吉指出，放鬆監管是席捲全球的金融危機的罪魁禍首。削減銀行業監管是非常危險的。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週一收盤升破31大關，並創20個月新高。因美國1月薪資增幅不及預期，美元指數 走弱，亞幣趨升，且外商銀昨日明顯拋匯，盤初一開盤就有不少大型外商銀密集拋匯，令台幣開市不久即強升至30.830盤中高點，吸引進口商或壽險等有美元需求的買盤出籠；午後則延續近期農曆年後每日匯市走勢，台幣升幅較盤初溫和。昨日美元買方多來自進口商及壽險。至於央行，盤初雖提供美元買單支援流動性，不過量並不大，也並非積極干預阻貶台幣。預計今天成交區間在30.850~31.000。

**貨幣市場**

臺灣銀行間短率週一往低位靠攏。年後通貨回籠、外資匯入且邁入提存期初，令市場資金相當寬鬆，雖有龍頭銀行因存款走錢沒開門，但無礙利率往區間低位調整。人民幣市場部分，隔拆利率在1.50%-2.50%，一年天期cnh swap落在 2,360 -2,550。

**債券市場**

週一美國無重要數據公佈，股市表現維持高檔整理，但債券市場受到法國大選風險導致市場避險資金往債券流動，終場10年期美債利率下滑5.7bps收2.408%；30年期利率下滑4.3bps收3.047%，今日市場無重要數據公布，美債10年利率回測2.40%，若突破整體偏空走勢可能趨於區間震盪。

**期貨市場**

週一離岸人民幣盤整，日內波動區間在6.795-6.813之間。雖然目前消息面不多，但須提防人民幣以長K棒方式突破6.80關卡。美元指數在非農就業後行情趨於平緩，估計2月整理區間在98-101。離岸人民幣換匯點下挫，一個月235(-65)，一年期2420(-270)。期貨週一成交406口，成交約當金額0.11億美金，留倉口數2665口，約當留倉金額0.90億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/06 | TA | 外匯存底 | Jan | -- | $436.59b | $434.20b |
| 02/06-02/07 | CH | 外匯存底 | Jan | $3003.5b | -- | $3010.5b |
| 02/07 | TA | 貿易收支 | Jan | $3.67b | -- | $4.86b |
| 02/07 | TA | 出口(年比) | Jan | 8.00% | -- | 14.00% |
| 02/07 | TA | 進口(年比) | Jan | 10.40% | -- | 13.20% |
| 02/07 | US | 貿易收支 | Dec | -$45.0b | -- | -$45.2b |
| 02/07 | TA | CPI(年比) | Jan | 2.02% | -- | 1.70% |
| 02/07 | TA | WPI(年比) | Jan | 1.50% | -- | 1.41% |

**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。**