

**Market News**

**2017/02/10**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 31.046 | 31.12 | 31.032 |
| USD/CNY | 6.8638 | 6.8749 | 6.86 |
| USD/CNH | 6.8637 | 6.8642 | 6.8405 |
| USD/JPY | 113.25 | 113.35 | 111.74 |
| EUR/USD | 1.0655 | 1.071 | 1.0651 |
| AUD/USD | 0.7625 | 0.7664 | 0.7611 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | 0 |
| TAIBOR 3M | | 0.65922 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 4.6287 | -0.5606 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 4.9473 | -0.1948 |
| TW IRS 3Y | | 0.8682 | 0.0116 |
| TW IRS 5Y | | 1.095 | 0.02 |
| TW 5Y BOND | | 0.806 | -0.006 |
| TW 10Y BOND | | 1.1375 | 0.0217 |
| SHIBOR O/N | | 2.272 | -0.0045 |
| SHIBOR 1M | | 3.9839 | 0.0238 |
| SHIBOR 3M | | 4.144 | 0.0346 |
| CN 7Y BOND | | 3.219 | -0.022 |
| CN 10Y BOND | | 3.419 | -0.031 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68667 | -0.00111 |
| USD LIBOR 3M | | 1.03372 | -0.00445 |
| USD 10Y BOND | | 2.3948 | 0.0781 |
| USD 30Y BOND | | 3.0041 | 0.073 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.63 | 0.03 |
| WTI | | 53 | 0.08 |
| GOLD | | 1228.36 | -4.5 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20172.4 | 118.06 |
| Nasdaq | | 5715.18 | 32.726 |
| S&P 500 | | 2307.87 | 13.2 |
| DAX | | 11642.86 | 99.48 |
| SSEA | | 3316.268 | 16.959 |
| HIS | | 23485.13 | 40.01 |
| TAIEX | | 9590.18 | 51.59 |
| Nikkei 225 | | 18907.67 | 365.1 |
| KOSPI | | 2065.88 | 13.1 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 美國總統川普打算在未來幾周內宣佈雷根時代以來最為雄心勃勃的稅改計畫。這一消息推動美股和美元上漲，因市場寄望於公司稅率能夠調降。白宮發言人斯派塞(Sean Spicer)稍後對記者稱，川普將公佈一份全面的稅改計畫，包括對個人和企業減稅。
* 美國聖路易斯聯邦儲備銀行總裁布拉德稱，目前尚不清楚特朗普政府政策是否會刺激通脹和經濟成長加速，美國利率可能至少會在2017年底前保持在低位。他感覺今年美國聯邦儲備委員會(美聯儲/FED)只需要升息一次，並暗示3月可能不會行動。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元周四收升，隨韓元走穩，但量能稍淡。台股走揚，外商銀同步拋匯，外資也在股市買超，短期全球的政經情勢仍左右金融市場。股市回溫再創20個月高位，外資今日轉為匯入；至於出口商昨日美元拋盤力道稍小，央行的動作則仍不大。韓元昨日稍顯強勢，帶動台幣也揮別連續兩天的貶勢，轉收小升。不過匯市量能不振，出口商拋匯意願不高；至於進口商的量也不大。近日美國總統特朗普與中國、日本的關係一直是市場關注焦點，市場關切特朗普周五會見日本首相安倍晉三後續動向。預計今天成交區間在31.050~31.200。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周四略見走揚。有逾790億台幣的國際債券交割，部分銀行暫停買票，拆款也到期不續，令拆款利率往區間高位靠攏，短票利率則微幅上調。人民幣市場部分，隔拆利率在1.20%-2.00%，一年天期cnh swap落在 2,130 -2,280。

**債券市場**

週四美國公布初請失業金人數優於市場預期，加上美國總統川普表示將於未來2~3週提出稅改計畫，使得美債利率走勢彈升，終場10年期美債利率上揚5.9bps收2.395%；30年期利率上揚5.6bps收3.004%，今日市場關注美國進口物價與密大信心指數，美債10年券利率再次回到2.40%，短線利率走勢仍維持震盪整理。

**期貨市場**

週四離岸人民幣走貶，泰半時間在6.86反壓處整理，但美元逢低買盤力道不弱，人民幣6.85有撐，晚間美國總統宣布未來將公布重大稅務計畫，美元走強，人民幣貶破6.86。離岸人民幣換匯點下跌，一個月200(+5)，一年期2350(+20)。期貨週四成交522口，成交約當金額0.17億美金，留倉口數2585口，約當留倉金額0.77億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/09 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 4-Feb | 249k | 234k | 246k |
| 02/09 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 28-Jan | 2058k | 2078k | 2064k |
| 02/10 | US | 密西根大學市場氣氛 | Feb P | 98 | -- | 98.5 |
| 02/10 | CH | 貿易收支(人民幣) | Jan | 307.25b | -- | 275.40b |
| 02/10 | CH | 進口(年比)人民幣 | Jan | 15.20% | -- | 10.80% |
| 02/10 | CH | 出口(年比)人民幣 | Jan | 5.20% | -- | 0.60% |
| 02/10 | CH | 進口(年比) | Jan | 10.00% | -- | 3.10% |
| 02/10 | CH | 出口(年比) | Jan | 3.20% | -- | -6.10% |
| 02/10 | CH | 貿易收支 | Jan | $48.50b | -- | $40.82b |
| 02/10-02/15 | CH | 貨幣供給M2(年比) | Jan | 11.30% | -- | 11.30% |
| 02/10-02/15 | CH | New Yuan Loans CNY | Jan | 2440.0b | -- | 1040.0b |
| 02/10-02/15 | CH | 社會融資(人民幣) | Jan | 3000.0b | -- | 1630.0b |
| 02/10-02/18 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Jan | 1.40% | -- | 5.70% |
| 02/08 | TA | WPI(年比) | Jan | 1.50% | 2.72% | 1.41% |
| 02/08 | US | MBA 貸款申請指數 | 3-Feb | -- | 2.30% | -3.20% |
| 02/09 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 4-Feb | 249k | -- | 246k |
| 02/09 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 28-Jan | 2058k | -- | 2064k |
| 02/09-02/18 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Jan | 1.40% | -- | 5.70% |

**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。**