

**Market News**

**2017/02/21**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.804 | 30.819 | 30.785 |
| USD/CNY | 6.8665 | 6.8804 | 6.8664 |
| USD/CNH | 6.8576 | 6.8628 | 6.8421 |
| USD/JPY | 113.1 | 113.24 | 112.77 |
| EUR/USD | 1.0614 | 1.0635 | 1.0602 |
| AUD/USD | 0.7688 | 0.769 | 0.7659 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.17 | -0.04 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.536 | 0.6353 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.282 | 0.1641 |
| TW IRS 3Y | | 0.8672 | 0.0037 |
| TW IRS 5Y | | 1.1 | 0.01 |
| TW 5Y BOND | | 0.821 | -0.004 |
| TW 10Y BOND | | 1.121 | 0.0035 |
| SHIBOR O/N | | 2.4086 | 0.0486 |
| SHIBOR 1M | | 4.075 | 0.0098 |
| SHIBOR 3M | | 4.2622 | 0.0055 |
| CN 7Y BOND | | 3.199 | -0.012 |
| CN 10Y BOND | | 3.322 | -0.041 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68611 | 0 |
| USD LIBOR 3M | | 1.05233 | -0.00417 |
| USD 10Y BOND | | 2.4147 | 0.0232 |
| USD 30Y BOND | | 3.0231 | 0.0208 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 56.18 | -0.04 |
| WTI | | 53.4 | 0.22 |
| GOLD | | 1238.47 | -4.55 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20624.05 | 4.28 |
| Nasdaq | | 5838.578 | 23.678 |
| S&P 500 | | 2351.16 | 3.94 |
| DAX | | 11827.62 | 70.6 |
| SSEA | | 3352.964 | 39.686 |
| HIS | | 24033.74 | 112.34 |
| TAIEX | | 9753.2 | 14.32 |
| Nikkei 225 | | 19251.08 | 44.41 |
| KOSPI | | 2084.39 | 15.56 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 中國的獨立煉廠(“茶壺”煉廠)罕見地從北美長途進口重油，交易員稱這種狀況的出現，主要因為石油輸出國(OPEC)減產以及美國和加拿大充沛的供應。據消息人士和航運數據，1月有60萬桶美國墨西哥灣混合重油運抵中國。凱思爾頓商品國際(CCI)2月將從美國裝船100萬桶重油運往中國。茶壺煉廠進口近100萬桶Mars石油，4月運抵中國。
* 歐元區官員表示，希臘及其國際貸款人週一達成一致，由專家團隊擬定關於希臘養老金、所得稅和就業市場的改革計劃。完成這些改革計劃，希臘即有資格獲得更多低成本貸款援助。國際金主將派專家返回希臘，擬定改革計劃。改革涉及養老金、所得稅和就業市場方面。一旦就改革計劃達成一致，IMF將重新撰寫債務可持續性報告。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週一微幅收貶，連兩日下跌。匯銀人士稱，因國際投資人擔心歐洲的政治風險，避險需求走強，台幣則隨韓元等亞洲貨幣走跌。亞洲貨幣普遍下跌，外資也偏向匯出，不過出口商月底的拋匯需求，對台幣發揮了支撐作用。由於近日外資動作較不明確，台幣也難脫狹幅整理走勢，周一台幣兌美元收30.804。

**貨幣市場**

臺灣銀行間短率週一大致持平既有區間。本周國際債券交割變數明顯轉趨緩和，整體市場資金調度較有餘裕，不過銀行間與票券商承作兩周跨旬拆款仍成交在0.44%，帶動跨月短票利率也跟著居高難下，後續關注明日一年期定存單標售結果。人民幣市場部分，隔拆利率在1.00%-3.00%，一年天期cnh swap落在 2,450 -2,260。

**債券市場**

週一美債市場休市，本週市場關注Markit PMI、成屋與新屋銷售、Fed會議紀要等消息公佈，市場將關注本週紀要結果，短線市場維持Fed於今年度可能升息3次，目前美債利率由年初以來維持高檔震盪整理，操作建議暫以區間操作為宜。

**期貨市場**

週一離岸人民幣走貶，從6.85貶破6.86，仍維持在6.80-6.87箱型區間整理。週一美國休市，市場消息清淡，人民幣月底前仍以震盪整理居多。離岸人民幣換匯點一個月235(-65)，一年期2330(-80)。期貨週一成交4725口，約當成交金額1.77億美金，留倉口數3301口，約當留倉金額1.16億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/20 | TA | 出口訂單(年比) | Jan | 7.40% | 5.20% | 6.30% |
| 02/20 | TA | 國際收支經常帳餘額 | 4Q | -- | $18301m | $17090m |
| 02/21 | US | Markit美國製造業採購經理人指數 | Feb P | 55.3 | -- | 55 |
| 02/21 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Feb P | 55.8 | -- | 55.6 |
| 02/21 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Feb P | -- | -- | 55.8 |

**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。**