

**Market News**

**2017/02/23**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.779 | 30.83 | 30.7 |
| USD/CNY | 6.8778 | 6.8823 | 6.8764 |
| USD/CNH | 6.8573 | 6.8689 | 6.855 |
| USD/JPY | 113.31 | 113.73 | 112.91 |
| EUR/USD | 1.0558 | 1.0574 | 1.0494 |
| AUD/USD | 0.7703 | 0.7715 | 0.7667 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.2 | -0.01 |
| TAIBOR 3M | | 0.65911 | -0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 5.1113 | 0.2386 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 5.2233 | 0.08 |
| TW IRS 3Y | | 0.8622 | -0.0078 |
| TW IRS 5Y | | 1.085 | -0.0175 |
| TW 5Y BOND | | 0.8055 | -0.0045 |
| TW 10Y BOND | | 1.095 | -0.015 |
| SHIBOR O/N | | 2.4845 | 0.0015 |
| SHIBOR 1M | | 4.085 | 0.003 |
| SHIBOR 3M | | 4.2778 | 0.0074 |
| CN 7Y BOND | | 3.183 | -0.036 |
| CN 10Y BOND | | 3.335 | -0.038 |
| USD LIBOR O/N | | 0.68611 | 0 |
| USD LIBOR 3M | | 1.05344 | 0.00333 |
| USD 10Y BOND | | 2.4129 | -0.0161 |
| USD 30Y BOND | | 3.0327 | -0.0104 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 55.84 | 0.45 |
| WTI | | 53.59 | 0.45 |
| GOLD | | 1237.44 | 0.29 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20775.6 | 32.6 |
| Nasdaq | | 5860.625 | -5.324 |
| S&P 500 | | 2362.82 | -2.56 |
| DAX | | 11998.59 | 31.1 |
| SSEA | | 3414.936 | -2.505 |
| HIS | | 24201.96 | -79.78 |
| TAIEX | | 9778.78 | 26.7 |
| Nikkei 225 | | 19379.87 | -99.63 |
| KOSPI | | 2106.61 | 0.47 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 據美聯儲發布的上次貨幣政策會議記錄，多位美聯儲決策者稱，如果就業和通脹數據符合預期，“很快”再度加息可能是合適的。會議記錄還顯示出，特朗普政府新經濟計劃缺乏細節，給美聯儲帶來的不確定性的程度。美聯儲在此次會議上決定維持利率不變。
* 兩名駐北京的中國石油業高管表示，中國國企--振華石油已與雪佛龍(Chevron)簽訂初步協議，將購買後者位於孟加拉的天然氣田，作價約20億美元。這項協議倘若完成，將標誌著中國在孟加拉的首筆大型能源投資項目。但孟加拉國對該處氣田擁有優先否決權，可能會阻撓交易。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週三微幅收升，第二日走揚。主要因出口商月底拋匯需求的支撐，令台幣表現偏強。FED昨晚公佈會議記錄，會議內容令鷹派投資人失望，美元持平。而外資在臺灣股市連續11買超及韓元兌美元走升，均支撐台幣續強。週三台幣收在30.826。

**貨幣市場**

台灣銀行間跨月短率周三區間高位稍顯鬆動。距離月底僅剩兩個交易日，部分銀行為去化過剩資金，以較兩周拆款利率低1-2個基點與票券商承作一周拆款，帶動跨月短票利率也略靠向區間低位。人民幣市場部分，隔拆利率在2.00%-3.50%，一年天期cnh swap落在 2,310 -2,360。

**債券市場**

週三美債公佈成屋銷售小幅優於市場預期，而凌晨FOMC會議紀要雖表示可能加快升息，但3月份升息可能性仍不高，紀要公佈後美債利率下滑，終場美債10年券利率小幅下滑1.6bps收2.413%；30年券利率下滑0.8bps收3.033%，今日市場關注初請失業金數據，短線美債10年券暫維持於2.40%上下震盪整理。

**期貨市場**

週三離岸人民幣持平，仍舊維持區間整理，日內交投區間落在6.855-6.869附近，在區間上緣整理。週三美國聯準會公布前次開會會議記錄，紀錄內容令鷹派投資者失望，美元指數持平，市場關注下週五非農就業報告數據。離岸人民幣換匯點變化不大，一個月220 (+0)，一年期2320(+20)。期貨週三成交4014口，約當成交金額1.43億美金，留倉口數3111口，約當留倉金額1.21億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 02/22 | US | MBA 貸款申請指數 | 17-Feb | -- | -2.00% | -3.70% |
| 02/22 | US | 成屋銷售 | Jan | 5.55m | 5.69m | 5.49m |
| 02/22 | US | 成屋銷售 (月比) | Jan | 1.10% | 3.30% | -2.80% |
| 02/23 | TA | 工業生產(年比) | Jan | 2.95% | -- | 6.25% |
| 02/23 | US | 首次申請失業救濟金人數 | 18-Feb | 240k | -- | 239k |
| 02/23 | US | 連續申請失業救濟金人數 | 11-Feb | 2068k | -- | 2076k |

**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。**