

**Market News**

**2017/03/20**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.626 | 30.656 | 30.553 |
| USD/CNY | 6.898 | 6.9082 | 6.8973 |
| USD/CNH | 6.8865 | 6.8941 | 6.8684 |
| USD/JPY | 112.7 | 113.49 | 112.57 |
| EUR/USD | 1.0738 | 1.0782 | 1.0728 |
| AUD/USD | 0.7704 | 0.7718 | 0.7664 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.175 | -0.002 |
| TAIBOR 3M | | 0.65933 | 0.00011 |
| CNT TAIBOR 3M | | 4.4707 | -0.1233 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 4.9743 | -0.0937 |
| TW IRS 3Y | | 0.8838 | 0.0088 |
| TW IRS 5Y | | 1.13 | -0.004 |
| TW 5Y BOND | | 0.865 | -0.043 |
| TW 10Y BOND | | 1.1425 | 0.0267 |
| SHIBOR O/N | | 2.633 | 0.192 |
| SHIBOR 1M | | 4.2775 | 0.0557 |
| SHIBOR 3M | | 4.3507 | 0.024 |
| CN 7Y BOND | | 3.166 | -0.033 |
| CN 10Y BOND | | 3.322 | -0.01 |
| USD LIBOR O/N | | 0.92422 | -0.00156 |
| USD LIBOR 3M | | 1.15178 | 0 |
| USD 10Y BOND | | 2.5402 | 0.0075 |
| USD 30Y BOND | | 3.1506 | 0.0025 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 51.76 | -0.38 |
| WTI | | 48.78 | -0.46 |
| GOLD | | 1229.26 | 2.66 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20914.62 | -19.93 |
| Nasdaq | | 5900.997 | 0.237 |
| S&P 500 | | 2378.25 | -3.13 |
| DAX | | 12095.24 | 12.06 |
| SSEA | | 3423.01 | -33.056 |
| HIS | | 24288.28 | 21.65 |
| TAIEX | | 9908.69 | -16.53 |
| Nikkei 225 | | 19590.14 | -68.55 |
| KOSPI | | 2164.58 | -11.13 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 一名美國財政部高級官員表示，美國財長努欽本周首次出席20國集團(G20)會議時將為美國“積極爭取”利益，包括重申避免競爭性貨幣貶值的承諾。該官員向記者表示，努欽將敦促G20國家使用所有可動用的工具加強全球經濟成長。努欽將在周五和周六出席在德國舉行的20國集團財長和央行行長會議。
* 英國議會終於批準相關立法，賦予首相特雷莎梅啟動英國退出歐盟的權力。周一稍早英國下議院投票否決了上議院近幾周對退歐法案所做的修正，之後上議院也同意讓未經修訂的議案獲得通過。泰晤士報報導稱，蘇格蘭首席部長斯特金要求蘇格蘭在英國退歐前再次舉行獨立公投，對此英國首相特雷莎梅準備予以拒絕。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元市場週五盤初延續升值走勢，在外資大舉匯入及國際美元依舊偏弱帶動下，早盤台幣進一步走揚，惟台幣升值也吸引進口商及壽險業者進場買入美元，在多空兩方拉鋸下，台幣於30.550~30.650間震盪整理。短線美元回弱，加上外資匯入將令台幣走勢偏強，今日台幣交投區間預估30.550~30.650。

**貨幣市場**

台灣銀行間短率周五持穩。近期多家大型銀行陸續開出0.43%的跨月拆款，有效緩解了跨季的緊縮氣氛。預計本周將有更大型的銀行加入跨季拆款的行列，資金將更平穩寬鬆。人民幣市場部分，隔拆利率在1.70%-2.00%，一年天期cnh swap落在 1,879 -2,070。

**債券市場**

週五美國公佈經濟數據好壞不一，2月工業生產與上月份持平，市場預估成長0.2%，而3月份密大信心則小幅優於預期來到97.6，但通膨預期下滑，該數據公佈後帶動美債利率走跌，終場美債10年券利率下滑4bps收2.500%；30年券利率上揚4.1bps收3.110%，本週美國關注房屋銷售與耐久財訂單數據公佈，短線10年券維持高檔整理走勢。

**期貨市場**

週五離岸人民幣匯率早盤延續貶值走勢，午盤過後略呈震盪整理，盤中匯率最高貶至6.8900下方，本週市場無相關重要數據，後續關注6.90關卡是否再次站上。離岸人民幣換匯點小幅下滑，一個月降至180(-15)，一年期2030(-57)。人民幣匯率期貨市場週五成交量升至1,431口，約當金額0.5998億美金，留倉口數3,651口，約當留倉金額1.279億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 03/17 | CH | 外國直接投資(年比)人民幣 | Feb | -4.20% | 9.20% | -9.20% |
| 03/17 | US | 密西根大學市場氣氛 | Mar P | 97 | 97.6 | 96.3 |
| 03/17 | US | 領先指數 | Feb | 0.50% | 0.60% | 0.60% |
| 03/20 | TA | 出口訂單(年比) | Feb | 17.80% | -- | 5.20% |

**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。**