

**Market News**

**2017/05/03**

**1**

***Daily Recap***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **FX** | **Last** | **High** | **Low** |
| USD/TWD | 30.062 | 30.195 | 29.98 |
| USD/CNY | 6.8959 | 6.8975 | 6.8945 |
| USD/CNH | 6.8898 | 6.8998 | 6.888 |
| USD/JPY | 111.99 | 112.31 | 111.78 |
| EUR/USD | 1.093 | 1.0933 | 1.0888 |
| AUD/USD | 0.7536 | 0.7556 | 0.7511 |
| **Interest Rate** | | **Last** | **Chg** |
| TW O/N | | 0.169 | -0.003 |
| TAIBOR 3M | | 0.65833 | 0.00022 |
| CNT TAIBOR 3M | | 4.3929 | 0.12 |
| CNT TAIBOR 1Y | | 4.4971 | 0.0385 |
| TW IRS 3Y | | 0.8115 | -0.0025 |
| TW IRS 5Y | | 1.03 | 0.005 |
| TW 5Y BOND | | 0.808 | -0.011 |
| TW 10Y BOND | | 1.125 | 0.0039 |
| SHIBOR O/N | | 2.8175 | -0.0015 |
| SHIBOR 1M | | 4.027 | 0.0033 |
| SHIBOR 3M | | 4.3002 | 0.0028 |
| CN 7Y BOND | | 3.513 | 0.011 |
| CN 10Y BOND | | 3.496 | 0.023 |
| USD LIBOR O/N | | 0.92944 | -0.00112 |
| USD LIBOR 3M | | 1.17233 | 0.00277 |
| USD 10Y BOND | | 2.318 | 0.0001 |
| USD 30Y BOND | | 3.0023 | 0.0181 |
| **Commodity** | | **Last** | **Chg** |
| BRENT | | 50.46 | 0.55 |
| WTI | | 47.66 | 0.48 |
| GOLD | | 1256.76 | -0.32 |
| **Stock** | | **Last** | **Chg** |
| Dow Jones | | 20949.89 | 36.43 |
| Nasdaq | | 6095.366 | 3.764 |
| S&P 500 | | 2391.17 | 2.84 |
| DAX | | 12507.9 | 69.89 |
| SSEA | | 3292.002 | -11.44 |
| HIS | | 24696.13 | 81 |
| TAIEX | | 9941.27 | 69.27 |
| Nikkei 225 | | 19310.52 | 113.78 |
| KOSPI | | 2205.44 | -4.02 |
| Source: Bloomberg | | | |



* 日本央行總裁黑田東彥對由中國牽頭的亞洲基礎設施投資銀行發展壯大表示歡迎，並呼籲國際性貸款組織之間加強合作，以滿足亞洲飛快增長的基礎設施建設需求。黑田東彥的講話是迄今為止日本決策者對於亞投行不斷發展壯大最為有力的背書，儘管日本當局一些人將亞投行視作中國擴大其地區影響力的工具。
* 惠譽表示，在成為更重要的全球性貨幣的道路上，最近兩年人民幣前進的動力有所喪失，儘管其在2016年底被歷史性地納入國際貨幣金組織特別提款權(SDR)貨幣籃子。中國當局阻止資本外流的政策以及市場對人民幣貶值的擔憂，將在近期內阻礙人民幣的國際化。

**Market Recap**

**外匯市場**

台幣兌美元週二收升1.56角至逾兩年半新高，中止連兩日跌勢。由於外資匯入及韓元走強，帶動台幣早盤勁揚2角升破30元整數關卡，午後則因小額換匯需求湧現令台幣升幅收斂，後續關注外資匯入續航力道。外資連七日買超台股共計473.22億台幣，短線外資匯入炒熱股匯雙漲題材仍有望持續上演，惟隨著台幣勁揚或有吸引日圓等外幣換匯需求增溫，則將緩和台幣升勢，料台幣明日續在30元附近震蕩整理。預估今日成交區間在29.900～30.050。

**貨幣市場**

　　台灣銀行間短率週二大致維持區間低位。月初資金情勢更加寬鬆，銀行拆入意願不高，致使部分資金無法有效運用。市場資金充裕，料過了月初後銀行負數操作意願更高。人民幣市場部分，隔夜價格在2.80%-3.20，一年天期cnh swap落在 1,800 -1,950。

**債券市場**

週二美國無重要數據公佈，但美債市場受到油價與能源股下跌影響，利率向下小幅走跌，短線市場仍觀望本週FOMC會議，利率預估維持震盪整理，終場10年期美債利率下滑3.8bps收2.280%；30年期利率下滑3.3bps收2.969%，今日市場關注美國ADP就業報告與ISM非製造業指數公佈，短線10年券走勢預估維持於2.30%上下震盪整理。

**期貨市場**

人民幣兌美元即期週二窄幅整理微收升，而中間價則刷新三周低點。節後首日匯價波動區間依然有限，客盤實需購匯仍有，大行則繼續適度提供美元流動性，由於近期消息面比較平淡，預計這種橫盤窄幅整理走勢還將延續一段時間。近期離岸人民幣流動性小幅收緊，繼續抑制離岸做空衝動，午後兩地匯價再現明顯倒掛。換匯點一個月升至276(+42)，一年期1905(+85)。人民幣匯率期貨市場週二成交量放大為1215口，約當金額0.4502億美元，留倉口數2,658口，約當留倉金額1.0028億美金。

*Economic Data*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Country | Event | Period | Survey | Actual | Prior |
| 05/02 | TA | 日經台灣製造業採購經理人指數 | Apr | -- | 54.4 | 56.2 |
| 05/02 | CH | 財新中國製造業採購經理人指數 | Apr | 51.3 | 50.3 | 51.2 |
| 05/03 | US | MBA 貸款申請指數 | 28-Apr | -- | -- | 2.70% |
| 05/03 | US | ADP 就業變動 | Apr | 175k | -- | 263k |
| 05/03 | US | Markit美國服務業採購經理人指數 | Apr F | 52.5 | -- | 52.5 |
| 05/03 | US | Markit美國綜合採購經理人指數 | Apr F | -- | -- | 52.7 |
| 05/03 | US | ISM 非製造業綜合指數 | Apr | 55.8 | -- | 55.2 |
| 05/02-05/03 | US | Wards總車輛銷售 | Apr | 17.10m | 16.81m | 16.53m |
| 05/02-05/03 | US | Wards國內車輛銷售 | Apr | 13.30m | 13.12m | 12.97m |

**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。**