

Apr. 16, 24

FX	昨收盤	最高	最低	前收盤
USD-TWD	32.378	32.390	32.300	32.293
USD-JPY	154.28	154.45	152.98	153.23
USD-KRW	1388.0	1391.7	1379.1	1380.7
EUR-USD	1.0624	1.0665	1.062	1.0643
GBP-USD	1.2446	1.2499	1.2436	1.2452
AUD-USD	0.6442	0.6493	0.6438	0.6467
USD-CNH	7.2590	7.2678	7.2548	7.2673

MONEY & BOND	收盤價 %	漲跌
NTD O/N	0.8130	-0.0040
TAIBOR 3M	1.6200	0.0000
TAIBOR 6M	1.6600	0.0000
NTD 5Y 公債	1.4200	0.0000
NTD 10Y 公債	1.5460	0.0000
CNH HIBOR 1W	1.7970	-0.0230
CNH HIBOR 2W	1.8900	0.0120
USD CMS(IRS 備用利率) 2Y	5.0809	-0.0634
USD CMS(IRS 備用利率) 5Y	4.5697	-0.0815
USD CMS(IRS 備用利率) 10Y	4.4017	0.0000
USD CMS(IRS 備用利率) 30Y	4.1330	0.0000
SOFR O/N	5.3100	0.0000
SOFR 1M	5.3162	-0.0031
SOFR 3M	5.3171	-0.0106
SOFR CMS 2Y	4.8010	-0.0640
SOFR CMS 5Y	4.2860	-0.0820
SOFR CMS 10Y	4.1170	-0.0790
SOFR CMS 30Y	3.8470	-0.0620
USD 2Y BOND	4.9205	0.0239
USD 5Y BOND	4.6199	0.0615
USD 10Y BOND	4.6014	0.0798

STOCK	收盤價	漲跌	%
紐約道瓊	37735.11	-248.13	-0.65
NASDAQ	15885.02	-290.07	-1.79
德國 DAX	18026.58	96.26	0.54
日經 225	39232.80	-290.75	-0.74
台灣加權	20449.77	-286.80	-1.38

COMMODITY	收盤價	漲跌	%
布蘭特原油	90.10	-0.35	-0.39
黃金	2383.34	38.97	1.66

註:1.資料來源: Bloomberg, LSEG
2.美元 IRS 為前日報價非 Fixing 值

World Focus

➤ 以色列軍方高層周一表示，以色列將對伊朗周末的導彈和無人機襲擊作出回應，但沒有提供細節，與此同時，盟友呼籲以色列保持克制，以避免中東衝突升級。

Economic Indicators

上日(4/15)已公佈

國家	時間	指標	本期/預估	前值
歐元區	17:00	2月工業生產 YOY	-6.4%	-6.6%
美國	20:30	3月零售銷售 MOM	0.7%	0.9%

今日(4/16)將公佈

國家	時間	指標	本期/預估	前值
中國	10:00	1Q24 GDP YOY	4.6%	5.5%
美國	20:30	3月新屋開工	1.483M	1.521M

Daily Strategies
FX
➤ USD-TWD

受中東地緣政治風險升溫影響，台幣貶壓承重，周一終場無意外地以續貶作收、連三個交易日收黑；有鑑於美國強勁的零售數據進一步削弱聯準會的降息前景，市場避險需求抬頭，三大美股全數大幅收跌影響，這對台幣不啻為一警訊，料台幣今日將往 32.500 整數大關方向奔去。

➤ USD-JPY

由於美國 10 年期指標殖利率向上走升勢如破竹、一度甚至高至 4.6630%，令美元兌日幣匯價順勢抬頭、暫於 154.3 點位附近游走；考量日本官員仍舊僅以口頭示警，市場持續測試官方底線，料日幣短線上行空間相對受限，估美元-日幣交易今日將介於 154.0~155.0 間。

➤ EUR-USD

在美國公布零售銷售增幅超出預期後，帶動美元指數站上 106 關口觸及五個月來最高，令歐元兌美元持續跌向 1.06 關口附近；有鑑於市場認為 ECB 預備將為 6 月降息敞開大門，受美元走強和美歐利差擴大影響，將對歐元繼續承壓，估歐元-美元交易今日將介於 1.060~1.066 間。

➤ USD-CNH

投資人關注中東緊張局勢是否升級，雖人民幣外部壓力上升，但監管維穩的決心不變，令美元兌離岸人民幣匯率回軟至 7.26 關口附近；考量美中貨幣政策分化更趨明確，加上地緣局勢緊張也同時推高美元的避險需求，估人民幣匯價短線將可能續往 7.27 價位以上邁進。

USD/TWD、USD/JPY – By 外匯分析師(CSIA)劉家瑜

EUR/USD、USD/CNH – By 陳有忠

敬請參考本報告末頁之免責聲明

➤ FX Market

台幣 台幣連三日收貶創逾五個月新低，中東緊張股匯齊跌外資賣股匯出

➤ 台幣兌美元周一連三日收貶，創逾五個月新低。隨著中東緊張情勢升高，帶動避險買盤推升美元續強，促使台幣隨亞幣全線走弱，盤中一度貶向 32.400 整數關口，關注美元續漲空間及外資匯出續航力道；終場收 32.378；成交量 14.55 億美元。

外幣 強勁美國零售數據推動美元創五個月新高，日圓創 1990 年來最低

➤ 美元兌一籃子貨幣創下 11 月初以來新高，日圓跌至 1990 年以來最低，此前美國公布的數據顯示，3 月零售銷售增幅超預期。美元兌日圓報 154.19。美元指數最高觸及 106.23，為 11 月 2 日以來最高，尾盤上漲 0.24%，報 106.20。

人民幣 內外壓力趨增人民幣收創近五個月新低，關注周二中國經濟數據

➤ 人民幣兌美元即期周一收小跌刷新近五個月新低，距離日內交易區間下限僅一步之遙；中間價亦小跌 12 點至三周低位，和路透預測偏離仍近 1,500 點，表明監管仍無意放手。

➤ Stock Market

台股 收盤失守五、10 日均線，中東緊張情勢升溫令投資人尋求避險

➤ 台股周一收盤大跌 1.38%，五、10 日短期均線失守。因中東緊張局勢升溫令投資人避險需求上揚，台積電引領大盤走低；台灣加權股價指數收低 1.38% 至 20,449.77 點；成交量為 4,783 億台幣。

美股 大幅收低，受累於中東緊張局勢擔憂和美債收益率急升

➤ 美股周一大幅收低，稍早強勁的零售銷售報告帶來的提振作用被公債收益率急升，以及對伊朗和以色列之間地緣政治緊張局勢加劇的擔憂所蓋過。道指下跌 248.13 點，跌幅 0.65%，報 37,735.11 點；標普 500 指數收低 61.59 點，跌幅 1.20%，報 5,061.82 點；納指下挫 290.07 點，跌幅 1.79%，報 15,885.02 點。

➤ Money & Bond Market

台債 五、10 年公債收盤未成交，高度警戒明日 113/4R 的標售結果

➤ 台灣指標五、10 年公債周一收盤未成交。市場高度警戒本周二 113/4R 的標售結果，除藉此確認實質買盤的真實想法，殖利率曲線或有重新調整機會。

台幣 短率大致維穩，中東局勢緊張料令銀行操作心態趨向保守

➤ 台灣金融業間短率周一大致平穩。市場資金偏向充裕，需求稍弱，利率走向平穩。只不過，周末間國際地緣政治中東局勢緊張，外商銀可能降低風險胃納，亞幣料走弱，銀行心態趨向保守，應特別關注未來動向；隔夜銀行間拆款加權平均利率報 0.813%。

美債 指標公債收益率觸及五個月最高，3 月零售銷售數據強於預期

➤ 美國指標 10 年期公債收益率觸及五個月最高，此前 3 月零售銷售數據強於預期，暗示聯準會可能推遲今年的降息。30 年期公債收益率報 4.739%，上漲 13.5 個基點。指標 10 年期公債收益率上漲，報 4.6014%。



USD-TWD



USD-JPY



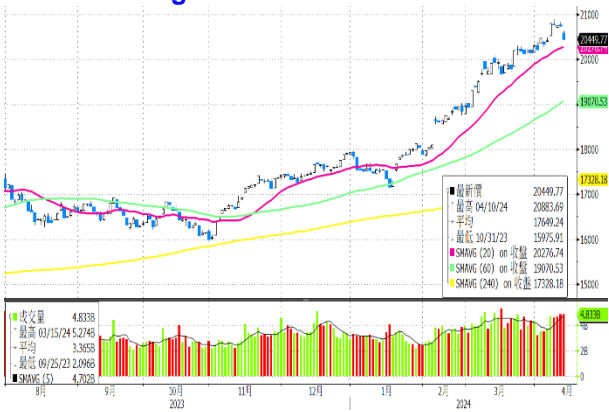
EUR-USD



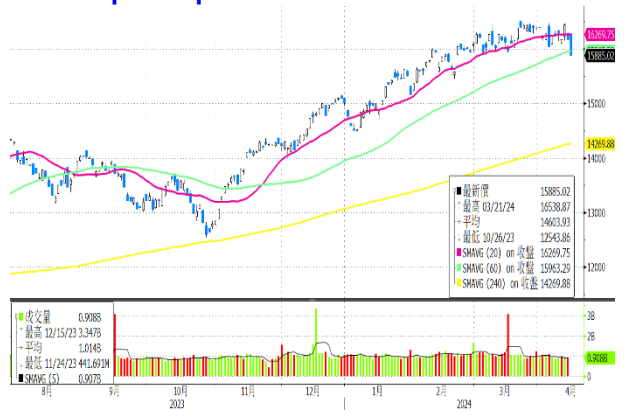
Taiwan & US 10Y Bond Yield



Taiwan Weighted Index



Nasdaq Composite Index



台新金控
Taishin Holdings

台新銀行金融市場事業總處 代表號：(02) 2326-8899

- | | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 簡展穎 #1866 | 謝敏貴 #2118 | 黃信璋 #5186 | 謝明志 #1177 | 陳煥良 #1184 | 趙毓齡 #5178 |
| 陳育婷 #5172 | 曾榮健 #5182 | 謝孟旺 #1120 | 鄧詠潔 #5160 | 湯振麒 #1152 | 劉方宇 #1160 |
| 周慧琳 #5177 | 林書薰 #5185 | 王明俊 #1182 | 江明璋 #5175 | 葉小鳳 #5196 | 鄭君婷 #5197 |
| 姚洪雯 #5187 | 吳培詩 #5198 | 王怡雯 #5190 | 簡子均 #5173 | 陳九霖 #1015 | 洪定鈞 #5176 |

免責聲明:

本報告之意見或資訊由台新銀行根據特定日期之各項市場資訊加以整理、彙整及分析，僅供參考，所有資料均取自可靠來源及本公司研究人員之判斷，惟台新銀行並不保證其即時性、正確性及完整性，如有錯漏或疏失，台新銀行不負任何法律責任，並請勿視為買賣匯率或其他投資之建議、邀約、招攬、宣傳或推薦買賣等任何形式之表示。投資人應選擇適合自身風險承受度之投資標的並自行判斷相關之法律、稅務及會計之效果，投資人如參考本報告進行相關投資或交易，應自行承擔所有風險及盈虧。此外，未經本公司允許，不得複製、修改、散發或引用本報告內容。