

台灣利率市場週評

2022/1/28

指標債券利率變動表	5yr	10yr	20yr	30yr
	A11103	A11102	A11101	A10113
1/21 收盤價	0.5930	0.6866	-----	1.1500
1/24~1/26 高點	0.5800	0.6910	-----	-----
1/24~1/26 低點	0.5800	0.66885	-----	-----
1/26 收盤價	0.5800	0.6900	-----	-----
漲跌幅	-1.30bps	+0.34bps	-----	-----

資料來源：證券櫃檯買賣中心

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
1/21 收盤價	0.6100	0.7125	0.7850	0.8400
1/24~1/26 高點	0.6150	0.7225	0.8100	0.8525
1/24~1/26 低點	0.6050	0.7100	0.7825	0.8350
1/26 收盤價	0.6050	0.7225	0.7950	0.8500
漲跌幅	-0.50bps	+1.00bps	+1.00bps	+1.00bp

上週回顧
[已公布之經濟數據]

日期時間	重要事件	資料期間	預估值	實際值	前期值
01/24/2022	Industrial Production YoY	Dec	9.50%	9.98%	12.19%
01/24/2022	Money Supply M1B Daily Avg YoY	Dec	--	12.75%	14.18%
01/24/2022	Money Supply M2 Daily Avg YoY	Dec	--	8.02%	8.26%
01/27/2022	GDP YoY	4Q A	3.85%	--	3.70%
01/27/2022	GDP Annual YoY	2021	6.00%	--	2.98%
01/27/2022	Monitoring Indicator	Dec	--	--	38
01/28/2022	Markit Taiwan PMI Mfg	Jan	--	--	55.5

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

本地債券 1/26 週三為農曆年節前最後的交易日 FOMC 會議結果表訂將於週四清晨出爐，高度不確定與長假因子下，整體市場並無交易，通週十年券利率反彈 0.34bps 以 0.69% 水準作收。

台灣利率市場週評

2022/1/28

利率交換市場狀況清淡，終場台幣五年 IRS 反彈 1.00bp 以 0.85% 作收。

✪ 本週操作策略與展望

[本週將公布之經濟數據]

日期時間	重要事件	資料期間	調查	前期
	無			

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，FOMC 會議結果顯示委員極度鷹派立場，須注意未來升息的路徑與幅度，觀望長假之後十年期公債的標售結果，操作上維持區間等待買點建議。

利率交換市場，境內 IRS 利率回調至合理區間，操作上建議區間交易。