

台灣利率市場週評

2022/6/6

指標債券利率變動表	5yr	10yr	20yr	30yr
5/27 收盤價	0.9111	1.1300	-----	1.7800
5/30~6/2 高點	1.0550	1.26500	-----	1.8200
5/30~6/2 低點	0.9551	1.1400	-----	1.8200
6/2 收盤價	1.0350	1.2300	-----	1.8200
漲跌幅	+12.39bps	+10.00bps	-----	+4.00bps

資料來源：證券櫃檯買賣中心

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
5/27 收盤價	1.0600	1.3400	1.4200	1.4100
5/30~6/2 高點	1.1600	1.5100	1.6800	1.6800
5/30~6/2 低點	1.0450	1.3200	1.4100	1.4000
6/2 收盤價	1.1300	1.5100	1.6200	1.6200
漲跌幅	+7.00bps	+17.00bps	+20.00bps	+21.00bp

★ 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
06/01/2022	S&P Global Taiwan PMI Mfg	May	--	50	51.7

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

拜登與聯儲主席的談話引發市場對於通膨優先的疑慮，此前對於九月可能暫停升息的預期消逝，美債利率大幅走升，台債利率同步自低位回彈，終場十年券利率反彈 10.00bps 以 1.23% 水準作收。

跟隨現貨走勢，利率交換水準大幅走高，終場台幣五年 IRS 大彈 21.00bp 以 1.62% 價位作收。

★ 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
------	------	------	----	----

台灣利率市場週評

2022/6/6

06/06/2022	Foreign Reserves	May	--	\$545.06b
06/07/2022	CPI Core YoY	May	--	2.53%
06/07/2022	CPI YoY	May	3.44%	3.38%
06/07/2022	WPI YoY	May	--	15.07%
06/08/2022	Trade Balance	May	--	\$4.91b
06/08/2022	Exports YoY	May	--	18.80%
06/08/2022	Imports YoY	May	--	26.70%

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，央行下調 364 天 NCD 發行金額至 1400 億，6/2 決標利率為 1.112%，目前對六月中旬升息幅度市場未能達成共識，短線利率可能處於區間大幅波動。

利率交換市場建議區間操作。