

台灣利率市場週評

2022/6/13

指標債券利率變動表	5yr	10yr	20yr	30yr
6/2 收盤價	1.0350	1.2300	-----	1.8200
6/6~6/10 高點	1.1050	1.2950	-----	-----
6/6~6/10 低點	1.0490	1.2865	-----	-----
6/10 收盤價	1.0900	1.2950	-----	-----
漲跌幅	+5.50bps	+6.50bps	-----	-----

資料來源：證券櫃檯買賣中心

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
6/2 收盤價	1.1300	1.5100	1.6200	1.6200
6/6~6/10 高點	1.1850	1.6400	1.7800	1.7100
6/6~6/10 低點	1.0950	1.5200	1.6300	1.5800
6/10 收盤價	1.1150	1.5350	1.6650	1.6200
漲跌幅	-1.50bps	+2.50bps	+4.00bps	-----

★ 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
06/06/2022	Foreign Reserves	May	--	\$548.85b	\$545.06b
06/07/2022	CPI YoY	May	3.32%	3.39%	3.38%
06/07/2022	WPI YoY	May	16.00%	16.62%	15.07%
06/07/2022	CPI Core YoY	May	2.60%	2.60%	2.53%
06/08/2022	Trade Balance	May	\$4.70b	\$2.41b	\$4.91b
06/08/2022	Exports YoY	May	14.10%	12.50%	18.80%
06/08/2022	Imports YoY	May	21.50%	26.70%	26.70%

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

美債利率在對於通膨的擔憂之下，十年美債重新站上 3% 以上水準，目前通膨問題難以有效解除，利率上行的壓力仍大，台債買賣報價拉寬，利率跟隨美債走高，終場十年券利率反彈 6.50bps 以 1.2950% 水準作收。

跟隨現貨走勢，利率交換水準震盪，終場台幣五年 IRS 以平盤 1.62% 價位作收。

台灣利率市場週評

2022/6/13

★ 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
06/16/2022	CBC Benchmark Interest Rate	16-Jun	1.625%	1.375%

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，交易商關注下週央行理監事會議結果，目前市場對於升息幅度並無共識，預期半碼與一碼的機率大致各為 50%，操作上建議等待央行議息會議結果出爐之後再行進場交易。

利率交換市場建議區間操作。