

台灣利率市場週評

2024/6/17

指標債券利率變動表	5yr	10yr	20yr	30yr
6/7 收盤價	1.4700	1.5950	1.8000	1.9600
6/10~6/14 高點	-----	1.6100	-----	1.9625
6/10~6/14 低點	1.4530	1.6100	-----	1.9625
6/14 收盤價	1.5100	1.63	1.8050	1.9625
漲跌幅	+4.00bps	+3.50bps	+0.5BP	+0.25BP

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
6/7 收盤價	1.67	1.685	1.71	1.75
6/10~6/14 高點	1.7025	1.725	1.743	1.788
6/10~6/14 低點	1.665	1.68	1.695	1.755
6/14 收盤價	1.7025	1.725	1.743	1.788
漲跌幅	+ 3.25bps	+ 4.00bps	+ 3.30bps	+ 3.80bps

☼ 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
06/13/2024	CBC Benchmark Interest Rate	2024/6/13	2.00 %	2.00 %	2.00 %

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

壽險結束賣壓市場成交清淡，6/13 台灣央行雖沒調整政策利率但是調升新台幣存款準備率 0.25% 緊縮市場資金，影響到短券利率比較多，對長券影響就還好，長券成交利率波動不大。半年券成交 1.33% 上升 6BP，2 年券成交 1.45% 上升 7BP。5、10 年券雖沒成交但報價區間放寬且上調 3-5BP，15-20 年券成交約上升 1-2BP，20 年成交 1.81%。

利率交換方面，原交易清淡，在台灣央行調升存準率後週五一早利率先上 8 點再下 4 點，終場 5Y IRS 以 1.79% 作收，較上周上彈 4BP。

☼ 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

2024/6/17

	無			
--	---	--	--	--

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，公債賣壓告一段落，存準率 7 月才會開始實施，央行動作讓市場解讀公債利率要往下的機率不高，公債依舊有補券需求，市場利率要待下周二 10 年期公債標售後才会有新的定價，目前預估 10 年期標售利率約 1.65%~1.70%。

利率交換方面，目前市場還在觀望調升存準率對貨幣市場的影響，另等待 10 年期公債標債結果。