

台灣利率市場週評

2021/5/17

指標債券利率變動表	2yr	5yr	10yr	20yr	30yr
	A08111	A10101	A10103	A10102	A10104
5/7 收盤價	-----	0.2500	0.3960	-----	-----
5/10~5/14 高點	-----	0.2700	0.4200	-----	-----
5/10~5/14 低點	-----	0.2700	0.4175	-----	-----
5/14 收盤價	-----	0.2700	0.4200	-----	-----
漲跌幅	-----	+2.00bp	+2.40bp	-----	-----

資料來源：證券櫃檯買賣中心

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
5/7 收盤價	0.5000	0.5200	0.5550	0.6650
5/10~5/14 高點	0.5050	0.5225	0.5700	0.6800
5/10~5/14 低點	0.4950	0.5100	0.5425	0.6575
5/14 收盤價	0.4975	0.5200	0.5450	0.6575
漲跌幅	-0.25bp	-----	-1.00bp	-0.75bp

☛ 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
	無				

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

雖本地疫情確認案例攀升，台股大幅震盪，台債跟隨美債小幅上行調整，對本地狀況反應有限，終場五年利率以 0.27% 價位作收反彈 2.00bps，十年券收 0.42% 反彈 2.40bps。

儘管現貨市場和美債維持區間，市場押注疫情升溫，IRS 利率小幅下跌，終場 5 年 IRS 下滑 0.75bp 收在 0.6575% 水準。

☛ 本週操作策略與展望
[本週將公布之經濟數據]

台灣利率市場週評

2021/5/17

日期時間	重要事件	資料期間	調查	前期
05/20/2021	Export Orders YoY	Apr	35.00%	33.30%
05/20/2021	BoP Current Account Balance	1Q	--	\$27334m
05/24/2021	Industrial Production YoY	Apr	--	16.78%
05/24/2021	Unemployment Rate	Apr	--	3.72%
05/24/2021	Money Supply M1B Daily Avg YoY	Apr	--	18.23%
05/24/2021	Money Supply M2 Daily Avg YoY	Apr	--	8.91%

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，台幣維持強勢走勢，本土疫情升溫不利台股，台債利率下行風險升高。

利率交換市場，跟隨現貨波動，建議逢高收固定端。