

台灣利率市場週評

2021/8/9

指標債券利率變動表	2yr	5yr	10yr	20yr	30yr
	A08111	A10101	A10107	A10105	A10104
7/30 收盤價	-----	0.2850	0.4050	-----	-----
8/2~8/6 高點	-----	0.2835	0.4000	-----	-----
8/2~8/6 低點	-----	0.2740	0.3830	-----	-----
8/6 收盤價	-----	0.2770	0.3990	-----	-----
漲跌幅	-----	-0.80bps	-0.60bps	-----	-----

資料來源：證券櫃檯買賣中心

利率交換變動表	1yr	2yr	3yr	5yr
7/30 收盤價	0.4900	0.5125	0.5500	0.6150
8/2~8/6 高點	0.4925	0.5100	0.5500	0.6100
8/2~8/6 低點	0.4850	0.5000	0.5375	0.5900
8/6 收盤價	0.4875	0.5025	0.5450	0.6075
漲跌幅	-0.25bps	-1.00bps	-0.50bps	-0.75bps

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
08/02/2021	Markit Taiwan PMI Mfg	Jul	--	59.7	57.6
08/05/2021	CPI Core YoY	Jul	1.30%	1.29%	1.36%
08/05/2021	CPI YoY	Jul	1.81%	1.95%	1.89%
08/05/2021	WPI YoY	Jul	--	11.77%	10.74%
08/05/2021	Foreign Reserves	Jul	--	\$543.08b	\$543.28b

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

台債維持狹幅區間交易成交清淡，指標十年增額新券決標利率 0.399% 大致符合市場預期，終場十年以 0.399% 價位作收通週下跌 0.60bp，五年以 0.277% 價位作收下跌 0.80bp。

受境外債券多頭堆動，國內 IRS 持續走低，終場 5 年 IRS 下跌 0.75bps 收在 0.6075% 水準。

台灣利率市場週評

2021/8/9

✪ 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	5 前期
08/09/2021	Trade Balance	Jul	\$5.40b	\$5.15b
08/09/2021	Exports YoY	Jul	33.40%	35.10%
08/09/2021	Imports YoY	Jul	39.20%	42.30%
08/13/2021	GDP YoY	2Q F	--	7.47%

[台灣公債市場與台幣利率交換市場]

展望後市，利率主要受實質買盤推動，預期仍將維持狹幅區間波動，操作上維持區間交億。

利率交換市場料將跟隨現貨波動，建議區間交易。