

# 致和證券債券部週報

2021/11/08

## 上週成交日國內金融市場概況

日期	市場附條件買回利率	隔夜拆款平均利率	債券市場			新台幣匯率
			5年	10年	20年	
			A09101	A09103	A09104	
11/01	0.25%	0.082	0.3505	0.5305	0.5342	27.850
11/02	0.25%	0.081	0.3505	0.5305	0.5342	27.850
11/03	0.25%	0.080	0.3505	0.5305	0.5342	27.853
11/04	0.25%	0.081	0.3505	0.5065	0.5342	27.866
11/05	0.25%	0.084	0.3505	0.5065	0.5342	27.882

## 上週成交日國外金融市場概況

日期	美元指數	一個月LIBOR利率	TED價差	美元兌日幣	美元兌人民幣
11/01	93.93	0.081130	9.08	114.10	6.39817
11/02	93.96	0.080880	8.92	114.15	6.39992
11/03	94.11	0.085500	8.91	114.07	6.40494
11/04	94.33	0.089630	9.37	113.85	6.39839
11/05	92.22	0.088630	9.41	113.40	6.40583

## 上週公佈的重要經濟指標及數據

經濟指標內容	公佈日期	結果	前期比較
美國10月ISM製造業指數PMI	11/01	60.8	-0.3
美國10月ISM非製造業指數NMI	11/03	66.7	+4.8
美國10月非農就業人口數	11/05	57.1萬	+0.3萬

### 台灣目前經濟指標

經濟指標內容	月份	數值	前期	下次發布日期
領先指標	2021/09	102.15	101.85	11/26
同時指標	2021/09	101.55	101.79	11/26
落後指標	2021/09	104.39	103.05	11/26

### 本週資金寬鬆緊縮因數

寬鬆因素		緊縮因素	
因數	金額(億)	因數	金額(億)
本週 NCD 到期	16282.8	NCD 發行	0
公債還本付息	531.9	公債發行	300.0
		公司債發行	8.2

### 本週投資建議

#### 台灣

5 年期公債 A09101	10 年期公債 A09103	20 年期公債 A09104
0.34~0.38%	0.48~0.53%	0.51%~0.57%

#### 美國

5 年期公債	10 年期公債	20 年期公債
1.06%~1.12%	1.48%~1.56%	1.88%~1.98%

### 未來重大財經訊息

11/09(21:30)美國 10 月生產者物價指數 PPI(年增)

11/10(21:30)美國 10 月消費者物價指數 CPI(年增)

11/12(23:00)美國 11 月密大消費者信心指數