

致和證券 債券部週報

2024/12/09

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	
			A13108	A13110	A13111	
12/02	0.60	0.817	1.4750	1.5806	1.7240	32.598
12/03	0.60	0.813	1.4754	1.5806	1.7240	32.536
12/04	0.60	0.822	1.4754	1.5806	1.7240	32.448
12/05	0.60	0.828	1.4754	1.5425	1.7240	32.438
12/06	0.60	0.826	1.4754	1.5425	1.7240	32.408

上週成交日國外金融市場概況

日期	美元指數	SOFR 利率	TED 價差	美元兌日幣	美元兌人民幣
12/02	106.36	4.64	35.562	150.170	7.28520
12/03	106.35	4.64	34.192	150.175	7.29580
12/04	106.32	4.59	38.912	150.455	7.28040
12/05	105.76	4.59	39.322	149.885	7.27095
12/06	105.99	4.60	45.342	150.295	7.26480

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 11 月 ISM 製造業指數 PMI	12/02	48.4	+1.9
美國 11 月非農業就業人數變化	12/06	227,000 人	+191,000 人
美國 11 月失業率	12/06	4.2%	+0.1%

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	2024/10	101.84	103.35	2024/12/27
同時指標	2024/10	104.10	105.90	2024/12/27
落後指標	2024/10	97.37	98.22	2024/12/27

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)
12/09 NCD 到期	3,334.25	NCD 發行	0
12/10 NCD 到期	1,778.00	公債發行	350
12/11 NCD 到期	2,487.50	公司債發行	70
12/12 NCD 到期	1,751.30		
12/13 NCD 到期	2,347.00		
合計	11,698.05		

本週投資建議

台灣

5 年期公債 A13108	10 年期公債 A13110	20 年期公債 A13111
1.45%~1.55%	1.53%~1.63%	1.67%~1.77%

美國

5 年期公債	10 年期公債	20 年期公債
4.00%~4.10%	4.12%~4.22%	4.40%~4.50%

未來重大財經訊息

- 12/11 美國 11 月消費者物價指數 CPI(年增率)
- 12/12 美國 11 月生產者物價指數 PPI(年增率)
- 12/12 美國前周初次申請失業救濟金人數