

致和證券債券部週報

2020/12/28

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	
12/21	0.25%	0.080%	0.1610%	0.2805%	0.3953%	28.517
12/22	0.25%	0.080%	0.1610%	0.2827%	0.3953%	28.545
12/23	0.25%	0.079%	0.1610%	0.2846%	0.3953%	28.555
12/24	0.25%	0.080%	0.1610%	0.2846%	0.3953%	28.533
12/25	0.25%	0.081%	0.1610%	0.2846%	0.3953%	28.541

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
12/21	90.09	0.145250	15.87	103.33	6.54819
12/22	90.61	0.143250	14.94	103.53	6.54302
12/23	90.33	0.148000	16.48	103.53	6.53949
12/24	90.33	0.145130	14.88	103.66	6.52798
12/25	90.22	0.145130	15.39	104.03	6.53000

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
美國第3季GDP成長率-終值	12/22	+33.4%	+64.8%
美國11月核心價格平減指數(年增)	12/23	+1.4%	0
美國12月密西根消費者信心指數-終值	12/23	80.7	+3.8

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	2020/11	107.45	105.95	01/27
同時指標	2020/11	104.21	103.01	01/27
落後指標	2020/11	97.75	97.89	01/27

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)
本週 NCD 到期	13928.25	NCD 發行	0
公債還本付息	6.375	公債發行	350.0
國庫券還本	250.0	公司債發行	278.0

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
0.15%~0.17%	0.27~0.30%	0.37%~0.41%

美國

5 年期公債	10 年期公債	20 年期公債
0.35%~0.39%	0.90%~0.95%	1.44%~1.48%

未來重大財經訊息

- 12/30 (21:45) 美國 12 月芝加哥 PMI
- 12/30 (23:30) 美國原油庫存變化
- 12/31 (21:30) 美國上周持續申請失業救濟人數