

致和證券 債券部週報

2024/11/04

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	
10/28	0.60	0.826	1.3400	1.2005	1.3950	32.090
10/29	0.60	0.825	1.3400	1.2005	1.3950	32.101
10/30	0.60	0.822	1.3288	1.2005	1.3950	32.031
11/01	0.60	0.816	1.3288	1.2005	1.3950	31.968

※2024/10/31 台股因受到康芮颱風影響，故休市一日。

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
10/28	104.29	4.82	23.972	153.345	7.13895
10/29	104.28	4.82	24.852	153.225	7.16065
10/30	104.10	4.81	26.982	153.155	7.13350
10/31	103.89	4.90	27.562	152.026	7.11780
11/01	104.32	4.86	32.912	152.615	7.13240

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 9 月個人消費支出物價指數 PCE(年增率)	10/31	2.7%	+0%
美國 10 月失業率	11/01	4.1%	+0%
美國 10 月非農業就業人數變化	11/01	12,000 人	-101,000 人

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	2024/09	103.35	104.09	2024/11/27
同時指標	2024/09	105.90	106.47	2024/11/27
落後指標	2024/09	98.22	98.85	2024/11/27

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)
11/04 NCD 到期	4,797.80	NCD 發行	1,400
11/05 NCD 到期	3,466.10	公債發行	0
11/06 NCD 到期	3,404.00	公司債發行	0
11/07 NCD 到期	0		
11/08 NCD 到期	4,629.30		
合計	16,297.20		

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
1.27%~1.37%	1.16%~1.26%	1.34%~1.44%

美國

5 年期公債	10 年期公債	20 年期公債
4.15%~4.25%	4.25%~4.35%	4.60%~4.70%

未來重大財經訊息

- 11/05 美國 10 月 ISM 非製造業指數 NMI
- 11/07 美國聯準會目標利率下限
- 11/08 美國 11 月密大消費者信心指數初值