2023.12.22

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,533.60 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,702.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,846.85 億元。

昨日整體資金還算充裕，發票量少，RP 利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 0.93-1.03%，公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.40%。

今日有央行 NCD 到期 1,573.00 億元。華泰銀及華南銀金融債交割 20 億元，市場短錢充裕因應年底的資金需求，對於跨年資金仍保守應對，預料今日短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%，公司債 RP 成交在 1.30%-1.40%。

附：債券附條件交易牌告利率

112/12/22	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.45%	0.45%	0.45%	0.45%	0.45%
RS	1.45%	1.45%	1.45%	1.45%	1.45%

註：本內容係取材於本公司(元大證券)認可之相關資料來源，但並不保證其完整性或正確性。
報告內容僅供參考，且不提供或嘗試遊說交易買賣之投資決策。
報告中所有的意見及預估，皆基於本公司於特訂日期所做的判斷，若有變更時本公司將不做預告。
客服專線：(02)2718-5886 (服務時間：每週一至週五 AM8：00~PM08：00)
版權所有元大證券，未經授權同意，不得將網站內容轉載於任何形式媒體 許可證號 110 年金管證總字第 0014 號

2023.12.22

公債交易

昨日受到美債利率走跌影響，台債冷券市場利率跟進下滑，但指標五年及十年券於等殖盤面均無成交，市場等待明年第一季的發債計畫出爐。

國外方面，美國第三季 GDP 季增年率終值下修至 4.9%，低於市場預期的 5.2%，同時第三季 PCE 季增年率終值也下修至 3.1%，前值為 3.6%，數據提振市場對 FED 明年降息的預期，不過終場美債回吐早前的漲幅，十年期美債上揚 1.48bps 收在 3.8918%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	12 月 20 日	12 月 21 日	漲跌(b.p.)
2 年	A12103	1.0300	1.0300	+0.00
5 年	A12108	1.1450	1.1450	+0.00
10 年	A12110	1.2130	1.2112	-0.18
20 年	A12109	1.3880	1.3880	+0.00
30 年	A12111	1.6000	1.5788	-2.12

註：本內容係取材於本公司(元大證券)認可之相關資料來源，但並不保證其完整性或正確性。
報告內容僅供參考，且不提供或嘗試遊說交易買賣之投資決策。
報告中所有的意見及預估，皆基於本公司於特訂日期所做的判斷，若有變更時本公司將不做預告。
客服專線：(02)2718-5886 (服務時間：每週一至週五 AM8：00~PM08：00)
版權所有元大證券，未經授權同意，不得將網站內容轉載於任何形式媒體 許可證號 110 年金管證總字第 0014 號