2024.01.09

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,463.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,514.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 81,112.35 億元。

昨日整體市場資金平穩偏小多，利率沒有太大變化，仍在區間內遊走。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%-1.35%。

今日有央行 NCD 到期 2,459.00 億元。市場資金供應充沛，加上無大型的緊縮因子影響，預料短期利率走勢仍將成交在區間內。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%-1.35%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/01/09	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

2024.01.09

公債交易

昨日市盤面上交投清淡，僅兩年券殖利率下跌 0.05 b.p.至 1.1395%，在資金成本處高擋下，短券追價動力薄弱。

國外方面，紐約聯儲公布去年 12 月消費者對一年通膨預期下滑至 3%，創 2021 年一月裡來新低，預期的下滑也降低聯準會的價格壓力，而達拉斯聯儲行長在週末表示，金融市場流動性趨緊的情況下，聯準會有可能需要放慢縮表腳步。終場十年期公債殖利率下跌 3 b.p.至 4.0153%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 5 日	1 月 8 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.1400	1.1395	-0.05
5 年	A13103R	1.1500	1.1500	+0.00
10 年	A13104	1.2112	1.2112	+0.00
20 年	A13102	1.3880	1.3880	+0.00
30 年	A12111	1.5800	1.5800	+0.00

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