2024.01.02

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 16,935.05 億元，緊縮因素有央行存單發行共 17,771.05 億，共增加發行 836.0 億元，上週時序進入月底及年底最後一週，部分投信端遭到贖回，加上銀行衝刺放款，資金需求增高，短期利率主要成交在區間高檔。30 天期自保票利率成交在 1.40%-1.42%，隔拆加權平均利率收在 0.692%，公債 RP 利率成交在 0.95%-1.05%。公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.40%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 15,213.45 億元，緊縮因素有 364 天期 NCD 及公司債交割共 1,435.0 億元。本週適逢新的月份及新提存期，市場資金需求不高，而投信及壽險將有新資金回流，預期短期利率將回落到利率區間的低檔。預估本週隔夜拆款成交利率在 0.65%-0.80%，公債 RP 利率成交在 0.95%-1.0%，公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

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

2024.01.02

公債交易

上週五為 2023 年最後一個交易日，台債市場交投冷清，指標五年及十年券均無成交。

國外方面，年底美債交投清淡，投資者消化了整週較為疲軟的經濟數據，終場美債利率小幅收高，十年期美債收在 3.86%，較前一日上行 1bp。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	12 月 28 日	12 月 29 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0300	1.0300	+0.00
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	1.5788	1.5788	+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