2024.01.23

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,798.05 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期 NCD 共 3,628.05 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,375.10 億元。

昨日金融機構將持續為農曆年前資金需求進行佈局，目前市場資金情勢寬鬆格局不變，短期利率仍是成交在區間內。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%-1.35%。

今日有央行 NCD 到期 5,263.00 億元。時序逐漸接近農曆新年，預料市場資金需求高峰將逐日顯現，但在目前整體市況寬鬆有餘的情況下，預料短期利率將成交在近期區間內。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

113/01/23	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

2024.01.23

公債交易

台灣 12 月外銷訂單年減 16%再度翻黑，主要受到全球經濟成長放緩，終端需求不佳。台債方面，市場觀望本周五年新券得標結果，終場十年期指標券收平在 1.235%，兩年期債券收跌 0.2 b.p.至 1.1255%。

國外方面，聯準會官員進入緘默期，市場等待第四季 GDP 及 12 月 PCE 指數等重要數據，終場十年期公債小跌 2.5 b.p.至 4.0976%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 19 日	1 月 22 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.1275	1.1255	-0.20
5 年	A13103R	1.1750	1.1750	+0.00
10 年	A13104	1.2350	1.2350	+0.00
20 年	A13102	1.3850	1.3850	+0.00
30 年	A12111	1.5700	1.5700	+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