

2019.01.30

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,910.00 億元，央行發行 28 天、91 天及 182 天期存單共 1,910.00 億元，截至昨日為止 NCD 未到期餘額為 7 兆 6,116.30 億元。

附買回市場，農曆春節前只剩下二個交易日，市場有些例行性支出出現，各方操作仍然保守，市場資金較為緊俏，短期利率往區間高檔靠攏。昨日公債 RP 區間在 0.37%~0.45%，公司債 RP 區間在 0.54%~0.60%。

今日有央行 NCD 到期 4,295.50 億元的寬鬆因子。農曆春節前最後交易日，市場資金需求持續增加，市場資金依舊緊俏，預料短期利率將成交在區間高檔。預估公債 RP 利率將成交在 0.37%-0.45%，公司債 RP 將成交在 0.54%~0.60%。

附：債券附條件交易牌告利率

108/01/30	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
RS	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%

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 104 年金管證總字第 0036 號

2019.01.30

公債交易

昨日台債十年指標債僅微量成交，收高於 0.8760%，年節前不具太大方向意義，而 10 年與 5 年力差持續拉大至 19.2bps，使得年後十年券於年後以利差而言將更具空間。

蘋果第一季營收大致符合預期，使得股市維持樂觀情緒小幅收漲，然美國正式起訴華為財務長孟晚舟並提出引渡，且本有望延長英國脫歐期限的修正案以些微差距未通過，避險情緒仍使美國十年公債收低至 2.71%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 28 日	1 月 29 日	漲跌(b.p.)
2 年	A07112	0.5235%	0.5235%	0.00
5 年	A08101	0.6711%	0.6711%	0.00
10 年	A08103	0.8700%	0.8760%	0.60
20 年	A08102	1.1600%	1.1600%	0.00
30 年	A07110	1.4450%	1.4450%	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 104 年金管證總字第 0036 號