

We Create Fortune

2024.01.29

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 24,629.75 億元,緊縮因素有央行存單發行共 23,832.65 億,共減少發行 797.10 億元,上週市場資金充裕下,短期利率成交在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.35%-1.40%,隔拆加權平均利率收在 0.686%,公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%。公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 17,731.95 億元,緊縮因素有 NCD 發行及公債交割 300 億元。預料本周市場資金進出波動增大,態度保守的情況下,預料短期利率將成交在近期區間上緣。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 0.93%-1.03%,公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。



We Create Fortune

2024.01.29

公債交易

上週五台債市場盤面交投清淡,指標五年券小幅下滑 0.5bps 收在 1.178%,觀察冷券市場,買 魁主要仍是在長端券種尋求較高的收益率,整體買氣尚佳。

國外方面,美國 12 月 PCE 平減指數年增 2.6%、月增 0.2%均符合預期,而核心的部分年增 2.9%低於預期的 3%及前值 3.2%,為近 3 年來首次跌破 3%,不過個人消費支出增長 0.7%高於預期的 0.5%,數據出爐後美債利率走高,十年期美債終場收在 4.16%,較前一天上揚 2.8bps。

附:收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1月25日	1月26日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.1300	1.1300	+0.00
5年	A13103R	1.1830	1.1780	-0.50
10年	A13104	1.2300	1.2300	+0.00
20 年	A13102	1.3850	1.3850	+0.00
30 年	A12111	1.5600	1.5490	-1.10