We Create Fortune

2024.01.24

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,263.0 億元,央行發行存單 7 天及 28 天期 NCD 共 4,682.50 億元,截至 昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,794.60 億元。

昨日整體市場轉趨平穩,到期大多能續作,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 6,151.70 億元。近期壽險端仍有資金需求,投信端則是短錢居多,整體 還算充裕,預料短期利率仍將成交在區間內。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

113/01/24	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%



We Create Fortune

2024.01.24

公債交易

台灣 12 月工業生產指數 90.4,年減 4%,主要受全球終端需求疲軟,廠商投資動能保守以及產業鏈去庫存所致。昨日台債市場交投冷清,盤面上僅兩年券成交在 1.13%,市場等待今日五年券標售結果。

國外方面,美國 2 年期公債中標殖利率與發行前交易一致,市場靜待本週公布之重要數據,終場十年期公債殖利率小漲 3.3 b.p.至 4.1378%。

附:收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1月22日	1月23日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.1255	1.1300	+0.45
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