We Create Fortune

2024.01.18

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,257.50 億元,央行發行存單 7 天及 182 天期 NCD 共 3,198.70 億元,截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,961.90 億元。

昨日整體市場資金依舊偏向寬鬆,投信、銀行及壽險皆有找券需求,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 3,696.00 億元,另有公債交割 300 億元。今日雖有公債交割的緊縮因素但因市場資金充裕下,預計影響有限,預期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

113/01/18	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

2024.01.18

## 公債交易

昨日受美債利率彈升影響,台債冷券市場利率微幅彈升,而指標券交投意願低迷,買盤縮手但空方亦沒有動力進場,指標五年及十年均無成交。

國外方面,英國 12 月 CPI 年增 4%,高於前值 3.9%及預期的 3.8%,月增 0.4%也同樣高於前值的-0.2%及預期的 0.2%,數據公布後推升歐債利率,也帶動美債利率走升,之後公布美國 12 月零售銷售數據,月增 0.6%高於預期的 0.4%,為三個月以來的最大漲幅,美債利率延續 彈勢,終場十年期美債上行 4.38bps 收在 4.1019%。

## 附:收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1月16日	1月17日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.1188	1.1188	+0.00
5年	A13103R	1.1710	1.1710	+0.00
10 年	A13104	1. 2200	1. 2200	+0.00
20 年	A13102	1.3830	1.3850	+0.20
30 年	A12111	1.5700	1.5700	+0.00