2024.01.22

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 17,672.00 億元，緊縮因素有央行存單發行共 17,169.40 億，共減少發行 502.6 億元，上週只有公債交割的緊縮因子，資金需求不高，在市場資金充裕下，短期利率仍是成交在區間內。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 0.695%，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 24,629.75 億元，緊縮因素有 NCD 發行。本週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%。

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

2024.01.22

公債交易

受上週美債殖利率彈升影響，週五台債利率稍有回升，但上方買盤報價積極使利率升幅不大。兩年期公債殖利率收高在 1.1275%，十年期公債殖利率收高在 1.235%。

國外方面，1 月密大消費者信心指數較 12 月上升 9.1 點至 78.8，創 2021 年七月新高，且一年期通膨預期降溫至 2.9%，創三年以來新低，顯示通膨逐漸趨緩。終場十年期公債殖利率上漲 0.6 b.p.至 4.1475%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 18 日	1 月 19 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.1200	1.1275	+0.75
5 年	A13103R	1.1750	1.1750	+0.00
10 年	A13104	1.2250	1.2350	+1.00
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